



粮食批发市场 与 期货市场

吴嘉本 陶志侠 梁战存 著

721

陕西人民出版社

序

中国共产党第十四次全国代表大会于1992年10月18日通过决议,确定我国经济体制改革的目标,是建立社会主义市场经济体制。这标志着我国的改革开放已经进入一个新的发展阶段,中国历史即将走向新的纪元。

建立社会主义市场经济体制是一项复杂的系统工程。粮食流通体制改革作为经济体制改革的一项重要内容,也将会是一个艰巨的任务。根据社会主义市场经济的要求和国务院的有关决定精神,粮食购销体制的深化改革就是要进一步向粮食商品化、经营市场化的方向推进。为了加快这项改革的进程,国家将要采取一系列措施,进一步加强对商品粮主产区的扶持,调动粮农发展优质粮的积极性,来培育充足的粮源;又要通过建立粮食储备体系和粮食风险基金,支持粮食部门实行企业化经营和粮食内外贸结合,继续发挥粮食部门在粮食流通中的重要作用,建立强有力的宏观调控机制,以便进一步增强国家对粮食的宏观调控能力。为此,国家还要采取相应措施,抓紧建设粮食市场体系,建立多渠道、多形式、多层次、多经济成分的粮食流通制度,以便尽快把粮食经营推向市场。这些措施的陆续出台,将会有许多新情况和新问题展现在人们面前。其中有关如何培育粮食市场体系,如何组织、引导、管好市场以及怎样进入市场参与交易等一些热门话题,必将引起人们的普遍关注。

建国后一段较长时期内,我国粮食一直由国家统一经营、统一管理,粮食购销以计划调节为主。粮食部门的任务主要是搞好产品分配与管理,保证低水平的供应。粮食实行多渠道经营并按双轨机制运行之后,这种状况虽有所改变,但因流通体制改革正处于新旧

体制转换交替之中,粮食工作也正处于由管理转向经营的过渡阶段,因而人们对于商品经营仍然不够习惯。许多人对规范化的粮食批发市场了解得不多,对期货市场还十分陌生,难以适应客观形势发展的需要。为了把粮食经营市场化的工作推向前进,所有从事粮食生产和经营的各方人士,除了转变观念、转换机制之外,都亟需加强学习,更新知识,了解粮食市场的基本情况,掌握市场的策略与技巧,使自己能够跻身于粮食批发市场和期货市场之中,始终立于不败之地。

由陕西省社会科学院和陕西省粮食经济学会吴嘉本、陶志侠、梁战存同志著的《粮食批发市场与期货市场》一书,以大量的资料,介绍了国内外粮食批发市场和期货市场的基本情况和管理经验,列举了参与市场交易的基本策略和必要技巧;从理论与实际的结合上,阐述了我国发展粮食批发市场和期货市场的必要性和可能性,提出了建设粮食市场体系的一些对策;融理论性、知识性和实用性于一体,可以作为各界人士了解粮食市场情况、研究市场经济理论的参考。尽管它在内容和编排上还有个别有待商榷之处,但作为研究、探索粮食市场的改革和普及市场知识的一种读物,仍不失为一本有现实意义和实用价值的好书。

我乐于为这本书作序,并向大家推荐。希望通过它的传播,能够对推动我国粮食批发市场和期货市场的发展有所帮助。

中国 市场 学 会 顾 问
陕西省粮食经济学会顾问
陕西省市场学会副会长

梁战存 陶志侠

1992年11月

目 录

上 篇 批发市场篇

第一章 我国粮食市场	(1)
第一节 粮食市场回顾	(1)
一、封建社会的粮食市场	(1)
二、半封建半殖民地社会的粮食市场	(5)
第二节 国民经济恢复时期的粮食市场	(8)
一、建国初期粮食市场基本状况	(8)
二、稳定粮食市场,制止粮价波动	(10)
三、恢复时期粮食市场存在的问题	(16)
第三节 统购统销时期的粮食市场	(20)
一、粮食统购统销政策的内容	(20)
二、统购统销初期的粮食市场	(21)
三、统购统销中后期的粮食市场	(24)
四、统购统销时期粮食市场存在的主要问题	(32)
第四节 合同订购时期的粮食市场	(33)
一、合同订购时期的粮食市场发展	(34)
二、合同订购时期粮食市场的主要问题	(36)
第五节 发展完善初级粮食市场	(39)
一、初级粮食市场在粮食流通中的地位 and 作用	(39)
二、抓紧初级粮食市场建设	(42)
第二章 建立健全粮食批发市场	(46)
第一节 建立粮食批发市场是粮食流通体制改革的重要	

内容	(46)
一、粮食批发市场发展状况	(46)
二、粮食批发市场产生和发展的必然性	(50)
三、粮食批发市场的意义	(52)
第二节 粮食批发市场组织与运作	(56)
一、粮食批发市场组织	(56)
二、粮食批发市场交易规则	(60)
三、市场运行制度	(61)
四、交易运作程序	(63)
第三节 建立健全粮食批发市场的对策	(65)
一、尽快制定全国粮食批发市场规划	(65)
二、深化配套改革	(65)
三、完善国家对粮食的计划指导和调控手段	(66)
四、培育粮食市场主体	(67)
五、加强批发市场法规制度建设,强化培训和信息交流	(69)
第三章 粮食批发市场布设	(71)
第一节 粮食批发市场布设的原则	(71)
一、有利于促进区域分工发展	(71)
二、有利于确保粮食区域平衡	(72)
三、有利于全国统一粮食市场形成	(72)
四、依托中心城市交通枢纽分级布设	(73)
第二节 粮食批发市场布局设想	(73)
一、中央级粮食批发市场	(73)
二、省区级粮食批发市场	(76)
三、地(市)级粮食批发市场	(78)
第三节 陕西省粮食批发市场展望	(79)
一、陕西省粮食生产及流向	(79)

二、陕西省粮食批发市场布设	(84)
---------------	------

中 篇 期货市场篇

第四章 粮食期货市场渊源	(89)
第一节 粮食期货市场概念	(89)
一、粮食期货交易与期货市场概念	(89)
二、粮食期货市场特征	(93)
三、粮食期货市场功能	(95)
第二节 粮食期货市场发展	(100)
一、粮食期货市场的产生与发展	(100)
二、我国粮食期货市场简况	(104)
三、世界主要粮食期货市场	(107)
第五章 粮食期货交易	(113)
第一节 粮食期货市场交易原理及运行机制	(113)
一、粮食期货交易原理	(113)
二、粮食期货市场运行机制	(115)
第二节 粮食期货市场交易程序及职能	(126)
一、粮食期货市场交易程序	(126)
二、粮食期货市场职能	(128)
第三节 粮食期货市场主要业务	(133)
一、套期保值业务	(133)
二、期货投机业务	(141)
第六章 粮食期货市场与社会主义市场经济	(144)
第一节 粮食流通呼唤改革	(144)
一、粮食流通举步维艰	(144)
二、粮食流通“双轨制”出现的新问题	(148)
三、粮食流通混乱的原因	(158)

第二节 粮食期货市场是社会主义市场经济的重要组成部分	
部分	(159)
一、社会主义市场经济发展的必然选择	(159)
二、体现社会主义市场经济的内在要求	(165)
三、国营粮食商业在期货市场上的重要作用	(173)
第三节 社会主义发展粮食期货市场的意义	(176)
一、能促进社会主义市场经济形成	(176)
二、有助于深化农村改革	(176)
三、协调粮食产销平衡	(177)
四、稳定粮食市场价格	(177)
五、保护生产者、经营者和消费者的利益	(177)
六、节约流通时间、节约流通费用	(178)
七、扩大粮食交易范围	(178)
八、有利于建立良好的市场秩序	(179)
九、促进和完善市场体系建设	(179)
第七章 有计划地发展粮食期货市场	(180)
第一节 粮食期货市场的环境条件	(180)
一、思想认识条件	(180)
二、经济条件	(183)
三、粮食商品条件	(185)
四、法律条件	(186)
五、技术条件	(186)
第二节 发展粮食期货市场的条件分析	(188)
一、社会主义市场经济是发展粮食期货市场的前提条件	(188)
二、改革开放为粮食期货市场奠定了基础	(188)
三、初期粮食期货交易性质的业务活动早已存在	(192)
四、我国初步具备建立粮食期货市场的基础条件	(195)

五、有可供借鉴的国内外经验	(197)
六、发展粮食期货市场有待解决的几个问题	(198)
第三节 积极稳妥发展粮食期货市场	(200)
一、发展粮食期货市场的途径	(200)
二、粮食期货市场的模式选择	(209)
三、粮食期货市场组织结构及交易规则	(218)
四、粮食期货市场管理	(221)

下 篇 期货交易篇

第八章 粮食期货交易策略	(226)
第一节 粮食期货交易一般策略	(226)
一、收集积累资料	(226)
二、正确判断价格变动趋势	(227)
三、制定计划	(229)
四、选准入市时机	(231)
五、短期为主	(232)
六、“多头”“空头”兼作	(233)
第二节 保值交易策略	(234)
一、套期保值交易策略	(234)
二、基差保值交易策略	(245)
第三节 投机交易策略	(253)
一、利用时间价差投机	(253)
二、利用市场价差投机	(258)
三、利用相关商品价差投机	(261)
第九章 期货市场价格趋势预测	(266)
第一节 基本因素分析预测	(267)
一、影响粮食期货市场商品价格波动的内因	(267)

二、影响粮食期货市场商品价格波动的外因	(270)
第二节 技术分析预测	(273)
一、技术资料分析预测	(273)
二、图形分析预测	(276)
附录:	
附录一 郑州粮食批发市场交易管理暂行规则	(298)
附录二 郑州粮食批发市场交易管理细则(暂行)	(307)
附录三 计量标准换算	(317)
1. 计量单位换算	(317)
2. 单位容积重量换算	(317)
3. 单位重量换算	(318)
主要参考资料	(320)
后记	(321)

上 篇

批发市场篇

第一章 我国粮食市场

第一节 粮食市场回顾

一、封建社会的粮食市场

粮食是人民生活须臾不可缺少的生活资料,所谓“民以食为天”就是这个意思。粮食也是最早进入市场交易的商品,或者说它是历史上最早出现的商品之一。早在西周时期,随着农业生产的发展,粮食除了自给自足以外,开始有了一些剩余产品,出现了初期的粮食交易市场。当时国都镐京的交易市场就设在王宫北面。从西周到清朝长达 3000 年的时间内,除了秦代对粮食实行统一管理,不许商人插手经营之外,其余周、汉、隋、唐、宋、元、明、清各代,都对粮食实行在国家宏观调控下的自由贸易政策。国家只征收赋粮,用来供应廪禄,保证军需;对于民食部分,主要通过自由贸易,

实行市场调节,但仍由国家采取平准、均输、常平、和籴、平糴等一系列措施,加强粮食市场管理,平抑粮价,调剂余缺。

秦汉时代是我国封建社会农业自然经济形成和巩固时期,粮食商品生产和粮食市场缓慢发展。唐代由于农田水利事业和农业生产技术的发展,粮食商品生产有了较大发展,粮食市场也有了相应发展,除了一些都市有粮食市场之外,各水陆交通要道有草市,农村有定期交易的集市,如墟市、集、行市、庙会等。当时粮食买卖主要是在地方小市场(墟集、草市)上的品种调剂和在小区域市场内供城镇人口需要。

由于江南水田的经营,农业生产工具和种植技术的改进,我国封建社会的农业生产力在宋代达到一个新阶段。城镇的兴起使宋代商业有了飞跃发展,粮食贸易的规模和范围都超越了前代。墟集、草市的粮食税收和商业税收几乎达全部商税的一半。北宋国都开封和南宋国都临安都有定期集市,并且出现了大批粮行和米铺。这些粮行、米铺大都集中在一定区域,形成米市。如北宋有米商百余家,贩买额高达千百万贯;又如临安的米市桥和黑桥等处,都是米行麇集的所在。水陆交通要道和官隘、津渡等处,草市正发展成为较大的市镇,如苏州、秀州、明州、广州等。这里有酒店、旅舍和店铺,粮食贸易十分活跃。乡村定期集市有了进一步发展,或三五日、或十天半个月一市。值得特别注意的是,我国南方诸地经济作物种植面积逐步扩大,提高了粮食商品化的程度,粮食长距离贩运开始出现。如福建地区人多地少,农民“多费良田,以种瓜植蔗”(《西山真文忠公集》卷15),粮食依靠商人从外地贩运。而当时两广地区尚未充分开发,地多旷土,粮食产量较高。福建的“福、兴、漳、泉四州,全仰广米,以给衣食”(《西山真文忠公集》卷15)。太湖地区“地方共几百里,多种柑桔桑麻,糊口之物,尽仰商贩”(《鸡肋篇》卷中)。江西地区在两宋时期是仅次于东南沿海的主要产粮区,除自给外,余粮大部分沿江销至外埠。

到了明朝,由于长江下游东南地区各省手工业的发展和农作物种植面积扩大,新兴起一批商业城镇,出现了汉口、苏州、佛山、天津、赣州这些大商埠。粮食长距离贩运有了较大发展,长距离粮食运销量年均达到1000万石,大范围的粮食流通市场初步形成,粮食市场显著扩大。明代粮食长距离运销主要集中在长江中下游和福建、广东,除漕粮外,毋需南粮北调。特别是明中期以后,粮食贸易十分活跃,全国各地的粮食基本都在流动中,嘉靖《河间府志》曾载,“其有售粟于京师者,青县、沧州、故城、兴济、东光、交河、景州、献县等处,皆漕挽,河间、肃宁、阜城、任邱等处皆陆运,间以舟运之”^①。明末,河南开封的粮食,亦由郑州、辉县、光州、固始等处运来^②。

清朝前期(鸦片战争前),由于社会生产的发展,粮食商品化程度提高,国内粮食市场继续扩大。主要表现在:

第一,粮食是国内市场流通中数量最大、最重要的商品。差不多所有商品都是直接或间接与粮食交换。据估算,鸦片战争前市场流通的粮食约为1040万吨,市场流通粮食价值占国内商品流通价值总额的39.7%,居第一位^③。

第二,粮食长距离运销的范围扩大。这是工商业兴旺发达,交通运输发展,以及大中小城市 and 市镇迅速兴起的结果。如佛山、汉口、景德、朱仙四镇,已发展成为与省会齐名的大都会。出现了长沙、九江、芜湖等大米市。粮食长距离运输已不仅限于长江中下游和福建、广东,粮食流距加长,全国范围的粮食贸易十分频繁。产粮区和缺粮区之间形成了相对固定的贸易关系,由北到南,主要的粮

① 嘉靖《河间府志》卷7,《风俗》。

② 佚名:《如梦录》。

③ 吴承明:《中国资本主义与国内市场》中国社会科学出版社,1985年3月第1版,第250—254页。

食长距离运销线路有 7 条：

(1)关东麦豆海运天津、山东、上海。关东是清代新开拓的粮食产区，“自康熙 24 年(公元 1685 年)开海禁，关东麦豆每年至上海者千余万石”，加上运往天津、山东的，关东年运出麦豆在 11000 万石左右。^①

(2)米麦经大运河北上运京畿、山西、陕西。主要是南方诸省的漕粮；私商贩运粮食数量也很大。官商两项粮食“由江淮溯运河而北，聚集豫省之河南、怀庆二府。由怀庆之清化镇进太行山口，运入山西。由河南府之三门砥柱运入潼关，”^② 供应陕西。年运销量在 600 万石左右。

(3)河南、天津麦粮运山东临清。临清是运河上重要的货物集散地，“临清为四方辐辏之区，地产麦谷，不敷用，优取资于商贩，从卫河泛舟车下者豫省为多，秣梁则自天津溯流而至”^③ 其数不详，大约数十万石已足。

(4)汉口麦谷经汉江运陕西。主要是湖北德安、襄阳一带余粮区的粮食经汉水运往陕南。年运销量为 60 万石左右。

(5)安徽、江西、湖广、四川的大米运往江浙。由于经济作物的大量种植和工商业的发展，江苏、浙江是缺粮最多的地区。明代江浙米主要仰给于安徽和江西，到了清代，这两者的余粮已远不能满足江浙的需求，要依靠湖广、四川的大米大量济运。四川、湖广都是清代新发展起来的粮食基地，特别是四川，产米颇丰。浙江总督李卫给雍正皇帝的奏折中称“臣查各省米谷，惟四川最多，湖广江西次之”。四川大米都是在汉口落岸，然后运往江浙。安徽、江西、湖广、四川每年运往江浙的米大约在 1500 万石左右。这些米大都是

① 包世臣：《安吴四种》卷 1，《中衢一勺海运南漕议》

② 朱轼：《輶车杂录》下，康熙六十年序。

③ 乾隆《临清直隶州志》卷 2，《市衢》。

先运到苏州枫桥，再通过苏州运销江浙和福建，使苏州成为当时最大的粮食集散地。

(6)江浙和台湾米运往福建。福建是经济作物和手工业发达较早的地区。明代主要运广东米大量接济，到清代，广东已自顾不暇，就主要依靠江浙和台湾米接济，年运销量不少于 200 万石。

(7)广西、湖南、江西米运广东。清代广东商品经济发展很快，成为严重缺粮省份，其米主要来自广西、江西、湖南也有米输往广东。年运销量大约 200 万石左右。

总计以上运路，进入长距离运销的粮食年约 3600 万石，占商品粮食流通总量的 21.6% 左右，是明代长距离运销量的 3 倍。

二、半封建半殖民地社会的粮食市场

(一)鸦片战争至抗日战争时期的粮食市场

1840 年鸦片战争以后，我国沦为半封建半殖民地社会。从鸦片战争到抗日战争结束 100 多年时间里，我国粮食市场的主要特点是：

1. 粮食市场集中于沿海口岸。随着列强入侵和外国资本输入，通商都市畸形发展，粮食销售市场集中于沿海口岸城市。原来最大的粮食集散地苏州，也日益萧条，无进无出。上海变为全国最大的粮食集散地，其次为天津和广州。据埠际贸易统计，1936 年粮食流通量共 723.6 万公担，其中以九江运出的 183.7 万公担为最多，内有 85% 运往上海；其次为芜湖，运出 161.9 万公担，行销南北大埠，较九江米为广；再次为长沙，运出 81 万公担，70% 以上运向上海。上海共运入 279.7 万公担，又大量进口洋米，故又运出 177.2 万公担，走广东、天津等 24 埠。运入广东 186.1 万公担，同时广东也有大量洋米进口，故有余米运往天津。天津共运入 119.6 万公

担,主要由上海运来。汉口则主要为中转口岸。^①

2. 国际粮食市场支配国内粮食市场。沿海口岸城市粮食行情已经和国际粮食市场相连通。由于帝国主义列强对我国进行粮食倾销,进口粮食支配了国内粮食市场。粮食市场价格受国内供求状况影响较小,更多地受国际粮食市场价格变化的影响,表现出明显的半殖民地性。1930年上海国产米价格每担为10.67元,洋米为9.75元;到1933年洋米价格下跌到5.27元,而国产米也不得不下跌为5.33元,4年期间跌落了48.2%。小麦是供国内面粉厂使用,并无出口,但是价格是以芝加哥小麦交易所的行情为转移。由于美国小麦大量涌进中国市场,中国麦价直线下降,1930年至1934年,由汉口运往上海的国产小麦,每担价格由5.33元跌至3.27元,跌落近40%,尽管这时国内小麦歉收,麦价理应上涨。国内粮食市场依附于国际市场,严重打击了我国粮食生产。1932年以来,我国江西、湖南等省稻米丰收,但在洋米跌价倾销的打击下,形成谷贱伤农,丰收成灾。1933年8月25日,湘、鄂、皖、豫、赣5省省主席联电国民党中央,请加征洋米进口税,电文称:“上年各地丰收,谷米产量大增,外洋米、麦同时输入倾销。……销路愈疲,价值低落,农民所需耕种各费罄谷之值,不能抵偿。”造成农业凋零。另外,在一些租界区内,形成了独立于国内的“世界粮食市场”,大肆盘剥中国人民,成为列强对中国进行经济侵略的一个重要组成部分。

3. 地区封锁加剧,粮食流通线路缩短。由于列强入侵和军阀割据,粮食地区封锁加剧,难以形成全国统一粮食市场。东北粮食基地沦陷于日本,四川也无米可出,湘鄂可外运的商品粮食数量骤减,四川米运汉口已停止,湘米运江浙也削减了2/3。

^① 吴承明:《中国资本主义与国内市场》中国社会科学出版社,1985年3月第1版,第291页。

抗日战争时期,日本帝国主义统治的沦陷区,实行粮食贸易统制,把粮食当作战略物资,取缔了粮食自由市场,民不聊生。日本侵略军在东三省建立伪满政权后,即制定《满洲国米谷管理法》,规定“米谷买入,由满洲粮谷有限公司一手经营,出售则由该公司卖给地方行政官署认可的米谷贩卖商。”^①伪满政府根据这个所谓“管理法”对余粮进行登记,实行“粮谷出荷”。所谓“粮谷出荷”就是强迫农民按照官定价格把指定粮食在规定时间内,如数交售给划定所在地区的日伪收购机构。日伪用这个政策劫夺了大量粮食。当时吉林省年产大豆85万吨,“出荷”竟达70万吨,占产量的82.3%;高粱、玉蜀黍、粟年产量为220万吨,“出荷”数为110万吨,占产量的50%。“出荷”付给官价与市价相差甚远,如大豆,农民“出荷”100公斤,市价值200元,官价仅17元,仅有市价的8.5%。“出荷”的粮食大量运往日本本土或其它国家。日本侵略者对关内沦陷区同样实行粮食贸易统制,如江南敌占区,无锡、常熟、芜湖等地,浙西、上海一带,粮食完全由三井、三菱以及军队合作社统制。

(二)解放战争时期的粮食市场

中华人民共和国成立前,由于中国长期遭受帝国主义、官僚资本主义和封建主义“三座大山”的压迫,饱经战火摧残和自然灾害侵袭,农业生产遭到严重破坏,粮食产量急剧下降,粮食供求矛盾十分突出。国民党统治区,由于反动派的横征暴敛和地主的残酷剥削,粮食生产急剧衰减,粮食市场供求矛盾十分尖锐,加之官僚资本家囤积居奇,政府滥发货币,物价飞涨,民众挣扎在死亡线上,激起群众“抢粮”之风潮此起彼伏,粮食市场极度混乱。在革命根据地,共产党和人民政府发动群众大搞粮食生产,同时实行粮食自由贸易政策,允许农民将剩余的粮食拿到市场交易,但对运往根据地

^① 《日本战争时食粮政策》国民党政府立法院,1942年12月版,第76页。

以外的粮食严加限制。显然,建国前,我国的粮食市场像祖国的大好河山一样,被分割而相互封锁,没有也不可能形成全国统一的粮食市场。

第二节 国民经济恢复时期 的粮食市场

一、建国初期粮食市场基本状况

(一)粮食供求矛盾突出

1949年10月,中华人民共和国宣告成立,为解决长期以来一直困扰中国人民的粮食问题奠定了牢固的政治基础。粮食产量迅速增长,1952年粮食产量达到16392万吨,超过了建国前最高年1936年的15000万吨;比1949年增长44.8%。同期内收购量增长96.8%,粮食产量增长速度仍然满足不了不断扩大的粮食需求。粮食需求量增加的主要因素是:第一,随着解放战争和经济建设的发展,需要由政府供应粮食的军政人员数量增加;第二,灾民数量增加。1949年全国各地自然灾害严重,自春至秋,旱、冻、虫、风、雹、水、疫等灾害相继发生,尤以水灾最为严重,全国被淹耕地约1亿亩,减产粮食600万吨,灾民约4000万人,其中已经断粮和即将断粮的灾民约700—800万人。进入1950年青黄不接之际,断粮人数继续增加,出现了全国性饥荒的严重情况;第三,一些原来靠吃部分进口粮食的大城市,由于海口被敌人封锁,进口粮源断绝,这些大城市的粮食也全部需要国内供应。这就使粮食供需矛盾、供求矛盾十分尖锐。加之粮食的管理体制未形成,地方之间的粮食余缺调剂渠道不畅,调剂十分困难,商品粮食并不掌握在中央政府手里。