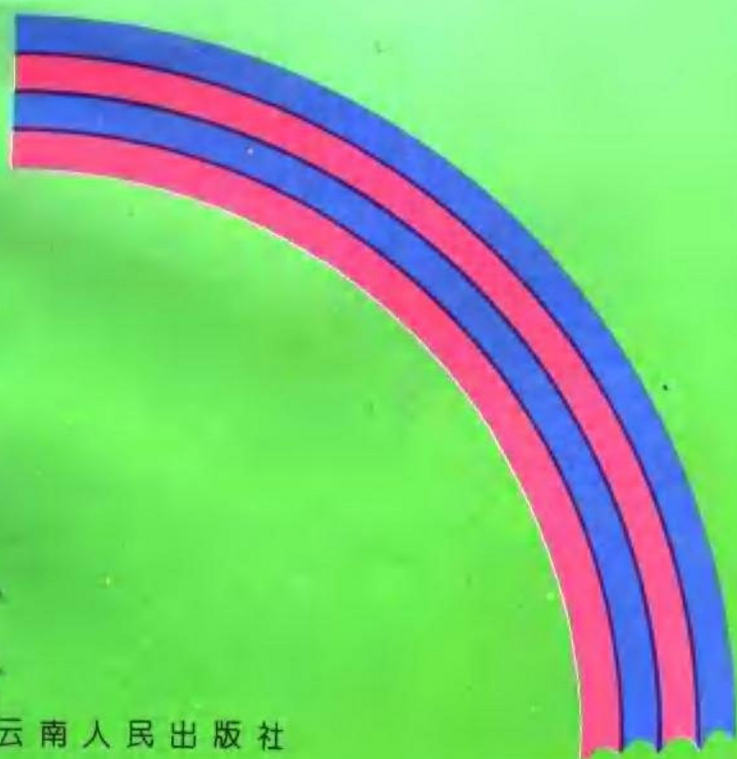


烟草 交易市场的建设 与 发展问题研究

缪克怡 著



云南人民出版社

782

烟草 交易市场的建设 与 发展问题研究

缪克怡 著

云南人民出版社

7748/13

(滇)新登字 01 号

责任编辑: 马 清

封面设计: 鞠洪深

烟草交易市场的建设与发展问题研究

缪克怡 著

云南人民出版社出版发行 (昆明市书林街 100 号)

云南新华印刷一厂 印装
云南新华彩印厂

开本: 850×1168 1/32 印张: 9.75 字数: 22.7 万

1994 年 11 月第 1 版 1994 年 11 月第 1 次印刷

印数: 1-10000 (其中精装 500)

ISBN 7-222-00844-6/F·118 定价: 14.30(精装)

定价: 9.30(平装)

107-782
#2

有益的探索（序）

何兆勇

党的十一届三中全会以来，在省委、省政府和国家烟草专卖局的领导下，在各级党委、政府和各行各业的关心支持下，云南烟草始终坚持了解放思想、更新观念、抓住机遇、大胆改革的指导原则，乘势而上，取得了举国瞩目的成就：烤烟生产从1980年的208万担发展到1993年的1600万担，约占全国烤烟总产量的1/3；卷烟生产从1980年的89万箱发展到1993年的532万箱，约占全国卷烟产量的1/6；“两烟”创税利从1980年的3.7亿元上升到1993年的216亿元，占全国烟草所创税利的近1/2。云南烟草还在技术、设备、生产、管理、营销、质量和市场等方面形成了自己的优势，为以后的发展奠定了坚实基础——云南烟草不仅已成为云南经济的支柱产业，也在全国雄踞了“烟草王国”的地位。

同云南烟草生产的发展一样，云南烟草市场的发展也经历了一个艰难的创业过程。经过营销战线十多年的奋斗，云南烟草产品市场已遍布全国30多个省市的广大地区，而且由开

始时比较分散的小市场，向进行集中交易，公开、公平竞争的大市场方向发展；由仅仅是进行现货交易，向还要进行期货交易的方向发展。这是云南烟草在注重生产的同时还十分注重市场开拓的可喜收获。

烟草市场随烟草生产的发展而发展，又为烟草生产产生着极大的促进和导向作用：烟草生产的价值要通过市场的转化加以实现；烟草生产要素的配置要通过市场机制的作用而达到合理；烟草生产的目标要通过市场的导向加以调整；烟草产品的质量要通过市场的检验才能得到真正的鉴定……所以说市场是生产和消费的中心环节，每一个烟草企业家都不可不对它加以高度重视。

理论来源于实践，又是实践的先导。我们重视烟草市场就应重视烟草市场理论的研究。党的十四届三中全会发布的在我国建立社会主义市场经济体制的决定，为我们烟草提供了走向大市场、大流通的方向和机遇，也从理论和实践的高度为我们烟草工作者提出了烟草这一特殊商品怎样走向市场的新课题。本书作者以马克思主义的流通理论为指导，从总结研究我省烟草交易市场的实践入手，并由此推及全国烟草和整个烟草市场营销的研究，提出了我国社会主义市场经济体制下烟草流通体制改革和市场体系建设的一些理论和设想。这是十分有益的探索，也是十分可喜的探索，他在烟草市场理论研究方面领先了一步！虽然他探索的结果不一定尽善尽美，但我相信它是会给关心烟草市场研究的同仁以启发，并推动这一研究在理论和实践上都取得更完美的成果的。

1994年8月10日 昆明

前 言

最近十年来，我国卷烟的生产量每年增长 5.5% 左右，到 1993 年，卷烟产量已占全球卷烟产量的 32%；烤烟生产量每年增长 10.5% 左右，约占全球烤烟产量的 38%。卷烟和烤烟生产的增长都大大高于全球的平均增长速度。我国烟草行业实现税利年递增 18%，又大大高于生产的增长幅度，烟草税利已占我国财政收入的将近十分之一。我国烟草突飞猛进地发展，同全球烟草发展缓慢，许多国家甚至是负增长形成了鲜明的对照，使世界烟草业的同行们惊叹不已。

笔者有幸在近十年中，先后从事过烤烟生产、卷烟生产、技术改造、经营管理以及卷烟销售等方面的工作。这十年既是我国经济体制深化改革的重要时期，也是从计划经济体制逐步向市场经济体制转变的关键时期。在实际工作中，深深地感到，改革开放给烟草行业带来了生机勃勃的活力，促进了烟草行业的高速发展。然而，在改革的进程中，也暴露出某些深层次的矛盾，主要是运行机制与市场经济的要求不相适应，按客观经济发展规律办事的意识比较薄弱，生产和交易都存在一定的盲目性，卷烟和烤烟生产发展速度过快，伪劣产品充斥市场，优质产品的灰色交易屡禁不止，既损害了国家的利益，也

同时损害了企业与消费者的利益。我们必须站在战略的高度来分析研究烟草行业面临的新问题，如果停滞不前，不继续进行深化改革，适应市场经济的要求，对今后的发展是极为不利的。

党的十四大明确提出要在本世纪末初步建立起社会主义市场经济体制的伟大目标，党的十四届三中全会进一步把十四大确定的经济体制改革的目标和基本原则加以系统化、具体化。它是我国建立社会主义市场经济体制的总体规划，是90年代进行经济体制改革的行动纲领。这就为烟草行业进行深化改革指明了方向与途径。作为一名烟草工作者，感到有义不容辞的责任为实现建立社会主义市场经济体制的伟大目标贡献一份力量。因此，笔者借近期参与流通领域进行改革的实践经验，结合多年理论的学习与研究，尝试着著写《烟草交易市场的建设与发展问题研究》奉献给读者讨论与参考。

本书力求遵循党的十四大和十四届三中全会指引的方向和途径，以马克思主义关于流通的理论及邓小平同志建设有中国特色的社会主义理论为指导，综合应用西方经济学、市场学、数理统计学等原理，采用辩证分析法和实证分析法，以云南省卷烟烤烟交易市场的实践为案例，并参考了国内外其他商品市场交易的经验，对我国烟草交易市场的建设与发展问题进行了全面、系统地分析。

本书的总体指导思想是，我国烟草行业的生产流通体制由原苏联模式的计划经济，经过有计划的商品经济，向社会主义市场经济体制过渡，必须从我国的实际情况出发，经历逐步深化改革的发展过程，它不可能一蹴而就。据此，提出对商品流通体制改革，需从建立以商品交易所为流通核心的市场体系着手，首先寻求建立、改进和完善初级的现货交易，进而向规范

的期货交易过渡。

本书的特色在于抓住期货市场是商品社会市场体系的重要组成部分，期货交易是一种高级的流通形式这个关键，创见性地提出国际市场上未见的卷烟期货交易模式，从理论和实践的結合上，研究了在我国建立卷烟期货交易的必要性和可能性，从而提出建立卷烟期货交易管理运行机制，规范卷烟现货交易和进行卷烟期货交易的理论、原则、条件和具体的方式方法。

关于期货交易和期货市场在我国近期已有所恢复。如郑州、深圳、上海、北京等地以粮食、金属、石油等商品期货为目标的商品交易所正在建立，期货交易已起步运行。有的商品交易所，如上海金属交易所，正在探索与国际期货市场接轨，并有可能发展成为国际上又一个重要的金属期货交易场所。它们在建立和完善我国期货市场方面跨出的第一步，已取得良好的效果，有一些成功的经验，当然，也存在不少问题。由于期货的投机性和金融投资性很强，伴随着初步的实践，也就带来一场沸沸扬扬的讨论：在社会主义市场经济条件下，有必要恢复期货市场吗？尤其是实行国家专卖的烟草适不适宜期货交易？其说不一，见解各异。

笔者认为，期货交易是商品生产和商品交换发展到高级阶段的产物。期货市场从产生到现在已经有一百多年的历史，也可以说，其产生、发展、走向成熟并日趋完善，是市场自身发展的必然结果，是商品流通和商业文明的标志。从我国最近几年烟叶和卷烟的生产和交换的实际情况来看，生产严重脱离市场需求，价格波动幅度大，就此而言，引入期货交易充分发挥市场机制的作用，也有其必要性和迫切性。郑州、深圳、上海进行期货交易的实践证明，该讨论的重点不再是建立和发展期货市场有无必要的问题，而应该着重研究如何以健全的法治、

规范化的现货交易为基础，建立适合中国国情，具有社会主义特色的期货市场。像叶公好龙那样耳闻“期货”就畏首畏尾不行；追求时髦一哄而上，匆匆忙忙搞期货交易也有可能给我国经济正常运行带来不良的影响。如何发展中国的期货交易，如何规范市场的现货交易和期货交易，是一个科学的而又十分具体的问题。为此，笔者在这方面着重地进行了探索和研究，大胆地阐述了自己的一孔之见，希望能起到“抛砖引玉”的作用，希望对我国即将进行的烟草流通体制改革会有所裨益。

本书共分十章。第一、二章以介绍烟草和烟草的生产流通现状为主，同时介绍了商品和商品流通的一般知识；第三章论述烟草流通体制改革的客观必要性和可能性，提出了改革的方向；第四章主要对云南卷烟市场已经进行的现货交易进行初步分析，第五章重点探讨卷烟现货交易模式的规范化问题；第六章介绍商品期货交易和交易所的一般概念；第七章侧重讨论期货市场机制和期货交易的理论观点，其中主要的进展是，阐述了应用非均衡经济理论中关于配给系统的原理设计和改造卷烟的现货与期货交易模型的观点；第八章提出我国卷烟进行期货交易的设想；第九章集中讨论卷烟期货交易方式及其组织管理，并对场内运作形式发表了新的见解；第十章进行总结和展望的论述。本书附录部份还对有关期货交易的术语概念进行了简单的介绍与解释，搜集整理在附录中的国内外商品交易所规则，及一些典型的标准合约与交易资料，仅供从事这方面研究学习的读者参考。

本书是以笔者的硕士论文为基础改写的。在学习和论文写作期间，笔者还参加了云南省卷烟烤烟交易市场的筹划建设与实际管理操作，积累有一些实际工作经验；同昆明工学院管理工程系的许多专家们合作，一起主持了云南省科技攻关项目

《卷烟市场交易模式及其管理信息系统研究》的科研课题工作，得到了各方面热忱地指导和帮助。

课题组全体同志对卷烟现货交易模式所作的许多补充，特别是将交易模式成功地体现于计算机程序设计之中，并使计算机程序设计具备广泛的适应性与灵活性。他们付出的辛勤劳动，赢得了人们的赞誉，是使实证和交易取得成功的重要方面。课题组顾问有：朱应庚教授、吴健安教授、铁振国高级会计师和李天祥经理，课题组成员为：缪克怡高级经济师、杨肖鸳副研究员、杨保建副教授、赵强经济硕士、魏华荣副教授、董毅明讲师以及云南省卷烟销售公司董文俊经济师、赵汉科会计师。

李丽华教授作为导师指导了笔者的硕士学位课题和论文。在本书的整个完成过程中，她不论是对理论方面还是对文章的构思、逻辑表达方面，甚至对文字的推敲，都要求十分严格。

赵强同志搜集大量的资料，为书中论述的许多地方作了不少的补充铺垫，并负责编写了附录部份。

本书写作过程中还得到了云南省市场学会会长吴健安教授和云南大学经济学院副院长徐光远副教授的帮助，得到了云南省烟草公司领导何兆寿经理、杨有珠副经理、铁振国副经理的指导，得到了我的同行、同事和文印工作的同志们的鼓励和热情支持，是他们的帮助才使本书得以按时完成。

在此，谨对以上各位专家、学者、各位老师、同志和朋友们表示衷心的感谢。

笔者

1994年5月

目 录

〔 1 〕	有益的探索(序)
〔 1 〕	前言
〔 1 〕	第一章 概述
〔 1 〕	一、导论
〔 5 〕	二、市场的产生与发展
〔 5 〕	1、商品和商品的交换
〔 7 〕	2、商品市场的发展
〔 9 〕	三、烟草的历史与沿革
〔 9 〕	1、烟草溯源
〔 11 〕	2、烟草的发展
〔 13 〕	3、一直存在的争议
〔 15 〕	四、全球烟草的现状
〔 15 〕	1、国外的现状
〔 18 〕	2、我国的现状
〔 22 〕	第二章 烟草的生产与经营
〔 22 〕	一、美、英、日三国的烟草概况
〔 22 〕	1、产销经营和流通体制情况
〔 28 〕	2、营销体制的特点
〔 30 〕	二、我国的烟草发展概况

-
- [30] 1、产销经营发展的情况
- [40] 2、云南烟草的发展取向
- [43] **第三章 我国卷烟流通存在的问题**
- [43] **一、我国卷烟流通的现状**
- [43] 1、流通体制情况
- [44] 2、经营管理特点
- [48] 3、卷烟流通存在的问题
- [54] **二、改革的出路**
- [54] 1、改革的尝试
- [55] 2、改革的方向
- [59] **第四章 云南卷烟市场现货交易分析**
- [59] **一、交易的基本情况**
- [59] 1、交易情况述评
- [63] 2、成交数据图表
- [67] **二、交易市场交易的意义**
- [67] 1、现实意义
- [68] 2、发展意义
- [69] **三、云南卷烟交易市场交易的特点**
- [69] 1、一般性与特殊性
- [70] 2、让利的交易价格
- [72] **四、有待解决的主要问题**
- [72] 1、外部环境方面
- [75] 2、交易市场内部环境方面
- [80] **第五章 完善卷烟现货交易方式的探讨**
- [80] **一、交易曲线与供求平衡**
- [80] 1、需求表与需求曲线
- [82] 2、供给表与供给曲线

-
- [83] 3、供给与需求的平衡
- [85] **二、交易方式探讨**
- [85] 1、方案 A—以均衡价格理论作指导
- [88] 2、方案 B—以等效用合同线理论作指导
- [91] 3、方案 C—以数量统计原理作指导
- [102] **第六章 商品的期货交易**
- [102] **一、基本概念**
- [102] 1、期货交易的由来
- [104] 2、期货交易的概念
- [108] 3、期货市场
- [111] **二、国内外的商品交易所**
- [113] 1、西方主要的商品交易所
- [117] 2、我国的商品交易所
- [118] 3、俄罗斯商品交易所的特点
- [120] **第七章 有关期货交易的理论和观点**
- [120] **一、期货市场机制**
- [122] 1、价格发现及其导向的机制
- [123] 2、价格风险回避与分散风险的机制
- [125] 3、期货交易的投机机制
- [127] 4、期货交易节约社会劳动与社会资源的机制
- [128] **二、期货交易价格理论**
- [128] 1、均衡理论及其价格波动之说
- [130] 2、非均衡理论及其配给系统
- [132] 3、预期与仓储理论及其价格波动之说
- [136] **三、经济学界对我国期货市场建设的一些观点**

-
- [136] 1、中国要不要发展期货市场的问题
- [138] 2、怎样建设我国期货市场的问题
- [141] 第八章 烟草期货交易的条件与步骤
- [141] 一、期货上市商品条件与期货交易的意义
- [141] 1、一般期货商品的上市条件
- [142] 2、烟叶进行期货交易的优选条件
- [145] 3、卷烟进行期货交易的基本条件
- [148] 4、卷烟进行期货交易的意义
- [153] 二、开展卷烟期货交易的步骤
- [153] 1、规范起步
- [155] 2、循序渐进
- [157] 3、具体步骤
- [159] 第九章 卷烟期货交易方式及其组织管理
- [159] 一、卷烟期货交易方式
- [159] 1、期货合约的标准化
- [162] 2、期货交易的控制
- [164] 3、期货交易的导向
- [166] 二、卷烟期货的组织与管理
- [166] 1、期货会员制
- [166] 2、期货保证金制
- [167] 3、指定仓库交、提货制
- [168] 4、场内交易运作形式
- [169] 三、卷烟期货交易的结算
- [169] 1、为什么期货要搞统一结算
- [172] 2、怎样组织卷烟期货的统一结算
- [174] 3、结算所的责任和权力

-
- 〔176〕 第十章 结论与展望
- 〔177〕 一、交易市场——流通改革的重要途径
- 〔177〕 1、烟草流通改革的趋向
- 〔179〕 2、烟草交易市场将遵循的原则
- 〔182〕 二、未来烟草生产和流通的发展趋势
- 〔182〕 1、生产相对集中化
- 〔187〕 2、流通逐步市场化
- 〔190〕 3、管理科学化法治化
- 〔197〕 附表
- 〔202〕 附录 I 期货交易术语
- 〔202〕 一、概念类术语
- 〔211〕 二、交易类术语
- 〔223〕 三、管理类术语
- 〔228〕 附录 II 中外期货交易资料
- 〔228〕 一、美国期货交易资料
- 〔240〕 二、亚洲地区期货交易资料
- 〔254〕 三、中国郑州商品交易所期货交易细则
- 〔273〕 四、深圳有色金属交易所管理暂行规定
- 〔277〕 五、有关计量标准换算表
- 〔282〕 附录 III 云南卷烟交易市场资料
- 〔282〕 一、云南省卷烟烤烟交易市场《卷烟交易规则》(试行)
- 〔286〕 二、云南省卷烟交易市场交易情况汇总表
- 〔290〕 三、几种卷烟的场内还价分布情况
- 〔294〕 主要参考文献资料

第一章 概 述

一、导 论

烟草是一种人工栽培的具有一定毒性的植物，其叶片内平均含有 1.5%左右的尼古丁。烟草性喜温暖，对种植的土壤、日照、给排水等条件有一定的内在要求。美国是最早对烟草品质进行研究的国家，他们培育、推广烟草良种使种植水平大大提高，并推进了包括弗吉尼亚、南、北卡罗莱纳、得克萨斯、肯塔基、左治亚等州烟草种植带的形成和种植水平的提高，使得美国烟草始终处于世界领先水平。

烟草的主要用途是通过燃烧叶片，吸食烟气。虽然有经过加工以后放入口中咀嚼的嚼烟和通过鼻孔闻吸的鼻烟，但比重极小，未见进行大量的工业生产。现代分析手段分离出烟气中至少含有 5000 种不同的成份。吸烟者在得到某种刺激性、舒适感的同时，给自己也给别人及环境造成一定的危害，这是社会和科学家们不断争论的话题。

世界上的烟草品种很多，大致可以分为烤烟、白肋烟、晾晒烟、香料烟等四大类。其中，烤烟种植的比例最大，以烤烟为主要原料生产的卷烟（又称香烟）是全世界最主要的烟草消费品。所以本书讨论烟草的市场交易问题，主要是以卷烟作为代表。

烟草是一种重要的经济作物，具有较高的经济价值。在我

国财政收入中，烟草（包括农业、工业、商业在内）占的比重最大。1993年，我国烟草行业实现税利已突破400亿元，连续七年位居各行业排行的榜首，并且绝对数也遥遥在前。由于烟叶经过不太复杂的加工，制成卷烟消费使用，其价值便可呈数倍地增加，因此，很多国家都把烟草生产和烟草制品的销售作为增加财政收入的重要手段。

我国烟草行业中最具有代表性的是云南烟草。云南烟草在最近十几年期间迅速崛起，取得显著成就的经验表明，虽然不能忽视烟草具有较高经济价值的特点和云南具有得天独厚的自然条件这一客观事实，但是，最重要的原因是党的十一届三中全会以来，实行改革开放以经济建设为中心路线的正确；是实行专卖管理，垄断经营，加强宏观调控，给全行业创造了良好的生产经营发展条件；是紧紧抓住机遇，把握住自己的优势，适时调整经济发展战略的结果；是云南烟草业能够充分发挥整体的力量与集体的智慧，始终坚持把产品质量放在第一位，不断培育与开拓市场的结果；云南的领导集体还具有超前意识与进取精神，发掘培养出一大批善经营会管理的企业干部与能打硬仗又有精湛技艺的职工队伍。继续发扬这种改革开拓进取的精神，我国烟草行业在未来的社会主义市场经济建设中，就一定能够为我国市场经济新体制建设，为云南烟草的更大发展做出更加辉煌的成就。

我国烟草行业成功发展的历史经验，在社会化大生产条件已初步形成，我国社会主义市场经济体制目标已经确定，社会生产力已经发展以后，不一定完全适用了。新形势下面临着许多新的问题，新的经济体制要求有新的经济运行方式和新的经济管理模式。所以，进一步深化改革烟草的生产流通和经营管理模式，是新经济体制提出的要求，是社会进步的客观需要。