

中·国·粮·食·安·全·问·题·研·究·丛·书



Liangshi Anquan

yu Nongchangepin Qihuo Shichang

粮食安全 与农产品期货市场

何蒲明 魏君英 著

国以民为本，民以食为天，食以粮为源。解决好中国人的粮食问题，确保国家粮食安全，具有重大而深远的战略意义，更是施政安邦的第一要务。

 中国农业出版社

中国粮食安全问题研究丛书

粮食安全与农产品期货市场

何蒲明 魏君英 著

中国农业出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

粮食安全与农产品期货市场 / 何蒲明, 魏君英著

. 一北京: 中国农业出版社, 2014. 11

ISBN 978-7-109-18988-1

I. ①粮… II. ①何… ②魏… III. ①粮食问题—研究—中国②农产品—期货市场—研究—中国 IV.
①F326.11②F724.5

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2014) 第 049526 号

中国农业出版社出版

(北京市朝阳区麦子店街 18 号楼)

(邮政编码 100125)

责任编辑 周 珊

北京中兴印刷有限公司印刷 新华书店北京发行所发行

2014 年 11 月第 1 版 2014 年 11 月北京第 1 次印刷

开本: 720mm×960mm 1/16 印张: 17.75

字数: 280 千字

定价: 38.00 元

(凡本版图书出现印刷、装订错误, 请向出版社发行部调换)

总 序

国以民为本，民以食为天，食以粮为源。古今中外无不把“粮食”视为治国安邦、施政福民之圭臬。粮食安全问题关乎国计民生，关乎社会发展，关乎政治安定，世界各国都把粮食安全作为国家经济、政治、社会安全的重要组成部分。如何解决好粮食问题，如何确保国家粮食安全，对于我国这样一个拥有 13 亿人口的发展中大国而言，具有重大而深远的战略意义，更是施政安民的第一要务。

改革开放以来，我国农业发展取得了举世瞩目的成就，粮食综合生产能力不断增强，粮食安全保障水平不断提高。特别是进入新世纪以来，我国农业连年丰收，主要农产品供求基本平衡。自 2004 年以来，我国粮食生产连续十年增产，到 2013 年，粮食产量达到 60 193.5 万吨，粮食生产突破历史最高水平，人均粮食产量达到或超过世界平均水平。我们可以自豪地说，我国用占世界 9% 左右的耕地、6% 左右的淡水，养活了占世界 20% 左右的人口，为在全球范围内消除饥饿与贫困做出了巨大贡献。

我们还要清醒地看到，随着工业化和城镇化的深入发展，市场化和全球化程度的加深，实现粮食供求平衡的压力加大，保障国家粮食安全的任务艰巨。从中长期看，我国人多地少的现实难以改变，人增地减的趋势难以扭转，淡水资源短缺、地区分布不平衡的形势更加严峻；随着经济社会的发展、人们生活水平的提高，人口数量的增加、膳食结构的改变、粮食加工业的发展，粮食供求关系日益趋紧；国际粮食供求形势不容乐观，粮食价格波动剧烈，粮食市场跌宕起伏，对我国粮食供求和价格都将产生深刻影响。总的来看，我国粮食供求偏

紧将成为一种常态，保障粮食安全的诸多隐忧更值得警惕和深思。

中共十八大报告明确提出，要加快发展现代农业，确保国家粮食安全和重要农产品有效供给。2013年12月召开的中央经济工作会议强调指出，要把切实保障国家粮食安全，作为经济工作的首要任务。2014年中央1号文件又进一步明确提出，要抓紧构建和实施以我为主、立足国内、确保产能、适度进口、科技支撑的国家粮食安全战略。要不断提升农业综合生产能力，确保谷物基本自给、口粮绝对安全。要更加积极地利用国际农产品市场和农业资源，有效调剂和补充国内粮食供给。要在重视粮食数量的同时，更加注重品质和质量安全；要在保障当期供给的同时，更加注重农业可持续发展。

为深入贯彻落实中共十八大、中央经济工作会议和2014年中央1号文件精神，全面系统地研究我国粮食安全的现状与未来，中国农业出版社组织国内权威专家编写了《中国粮食安全问题研究丛书》。粮食安全问题是一个十分复杂的问题，既涉及国内又涉及国外，既有生产问题又有流通问题，既有发展问题又有改革问题，既是经济问题又是政治问题，既有实践问题又有理论问题，需要各方面开展深入研究并进一步形成共识。该丛书共分12册，主要内容包括：粮食供求形势分析、粮食生产经营主体、粮食市场流通、粮食产业链和供应链、粮食安全预警机制、粮食主产区发展、粮食期货市场、粮食国际贸易等。该丛书立足中国国情，联系国际市场，紧扣粮食安全主题，从多角度、多方面深入分析研究有关粮食安全的影响因素，既注重理论分析，又有实证分析，并提出了很多有针对性的政策建议。该丛书作者均为粮食问题研究领域的权威专家学者，书中的很多观点和看法具有一定的创新性和前瞻性，不仅具有较高的理论价值，而且具有较强的应用价值。

该丛书是2013年中央农村工作会议后国内推出的首套全面系统介绍我国粮食安全问题的系列丛书。该丛书的出版对于增强我国粮食

综合生产能力，确保国家粮食安全，加快粮食主产区发展，促进农民增加收入，推进农业现代化具有十分重要的现实意义。该丛书对于我们把握当前我国粮食安全的状况与特点，分析新形势下我国粮食安全面临的问题和挑战，研究解决我国粮食安全问题的对策和措施具有积极的推动作用。该丛书既可以作为我国农业战线广大干部职工和科技工作者学习和研究我国粮食安全问题的参考资料，又可以为政府有关部门制定完善我国粮食安全战略和保障国家粮食安全政策措施提供借鉴。

我国粮食安全问题不仅是一个现实性的热点问题，更是一个需要长期关注的重点问题。随着经济社会的发展，粮食安全问题的研究范围也在不断拓宽和深化，比如粮食价格形成机制和市场调控问题、粮食品种质量和食品安全问题、实现高产高效与资源生态永续利用问题等。希望社会各界有识之士继续关注粮食安全问题，深入研究粮食安全问题，积极探索解决粮食安全问题的有效途径和办法，为切实保障中国人的粮食安全做出更大的贡献。

宋洪远

2014年5月13日

前 言

中国的特殊国情决定了粮食安全问题一直是社会各界关注的焦点问题之一，特别是由于国际粮食形势的风云变幻，粮食安全问题日益成为政府进行宏观决策所必须考虑的重要因素之一。而期货市场以其独特的经济功能，在维护粮食安全方面能够发挥其特殊的作用。从最近五年来的几个中央 1 号文件和“十一五”规划可以看出，党中央、国务院一直非常重视粮食安全问题和农产品期货市场的发展。

粮食期货市场是我国粮食市场体系的重要组成部分之一，我国的粮食期货市场建设已经取得长足进展，正在逐步向规范化、法制化和国家化轨道发展，在国际上的影响力也在快速提升。小麦、玉米和大豆等主要粮食品种，已经成为我国农产品期货的主力品种，而且稻谷期货也在社会各界的努力下，于 2009 年 4 月在郑州商品交易所成功上市。粮食期货市场的特有作用得到了有效的发挥。目前粮食期货市场已经与粮食收购市场、零售市场和批发市场共同构成了我国粮食市场的完整体系。多年的实践证明，积极发展粮食期货市场和稳步拓展粮食期货贸易，有效地利用期货市场特有的价格发现和风险转移的经济功能，对于指导农民种地卖粮、促进农民增收，对于帮助粮食企业开展套期保值，规避价格风险，完善粮食流通体制改革和粮食储备制度，为国家粮食宏观调控提供决策依据都具有积极的作用。

本书以农产品期货市场为手段，以保障粮食安全为目标，首先说明了期货市场的产生和发展的历史必然性；然后对中国农产品期货市场的有效性进行了检验；再围绕影响粮食安全的有关因素，阐述了其与农产品期货市场的关系，较为全面和系统地探索了在粮食购销市场

化的环境下，如何在稳定粮食生产和粮食价格、完善粮食流通体制和国家粮食储备制度、改善粮食国际贸易、增加农民收入、提高政府宏观调控的能力等方面，进一步发挥农产品期货市场的经济功能，为保障粮食安全提供一个新的角度和思路。显然，对以上问题的回答，无论在理论上还是在实践方面，均具有重要意义，尤其是在进一步深化粮食购销市场化改革的新形势下，对于突破传统的研究粮食安全问题的思路，用新的角度来研究和保障中国的粮食安全具有重要的参考价值。

本书在研究方法上采取理论分析与实证分析、宏观分析与微观分析相结合的方法，研究了如何利用农产品期货市场保障粮食安全，得出一些有价值的研究结论。

俗话说“工欲善其事，必先利其器”，利用期货市场保障粮食安全的前提是有一个完善的农产品期货市场，如果我们有一个覆盖广泛的、信息广为粮食经营者知悉和利用的农产品期货市场，既能减缓粮食产量和价格的波动，又能规避市场风险，还能增强政府调控粮食市场的能力，进而可以实现国家的粮食安全。因此，本书最后根据研究的基本结论，提出了相关政策建议。

何蒲明

2014年2月28日

目 录

总序

前言

第一章 导论	1
第一节 研究背景	1
第二节 基本概念界定	5
第三节 国内外研究动态	8
第二章 商品经济、市场经济与期货市场	25
第一节 商品经济的产生与发展	25
第二节 市场经济的产生与发展	29
第三节 期货市场的产生与发展	34
第四节 期货交易的基本特征	38
第五节 期货市场：市场经济发展的必然选择	45
第六节 期货市场在我国经济发展中作用的实证研究	53
第七节 期货市场优化微观资源配置的实证分析 ——以大豆期货为例	62
第三章 中国粮食期货市场经济功能的实证研究	67
第一节 农产品期货市场经济功能的评价指标	67
第二节 中国粮食期货市场经济功能的实证研究	73
第四章 粮食安全与农产品期货市场的内在关系	87
第一节 中国农产品期货市场的产生与发展	87

第二节	农产品期货市场的经济功能	93
第三节	粮食安全的评价指标	96
第四节	粮食安全与农产品期货市场的内在关系	101
第五章	粮食生产和价格与农产品期货市场	107
第一节	中国粮食生产波动的基本特征	107
第二节	中国粮食价格的波动分析	119
第三节	期货市场与现货市场的价格联动机制 及其相互作用	134
第六章	粮食流通与农产品期货市场	141
第一节	基于粮食安全的中国粮食流通体制改革	141
第二节	粮食购销市场化改革取得的初步成效及 面临的问题	152
第三节	利用期货市场完善粮食购销市场化改革	161
第四节	利用期货市场促进粮物流通发展：基于 粮食安全的视角	166
第七章	粮食储备与农产品期货市场	174
第一节	粮食储备的一般理论	174
第二节	中国粮食储备体系及其发展	177
第三节	粮食储备与粮食价格的关系分析	181
第四节	利用农产品期货市场完善粮食储备制度	186
第五节	案例分析	195
第八章	粮食贸易与农产品期货市场	198
第一节	中国粮食贸易的地位	198
第二节	中国需要合理利用国际市场解决粮食 安全问题	201
第三节	世界粮食贸易定价权与中国的定价地位	204

第四节 国内外农产品期货市场关系实证研究 ——以小麦为例	211
第五节 利用期货市场在国际市场上调剂粮食余缺	216
第九章 农民增收与农产品期货市场	222
第一节 直接补贴能否促进农民增收	222
第二节 保障粮食安全与提高农民收入的 “矛盾”分析	224
第三节 期货市场促进农民增收的机理分析	229
第四节 制约农民利用农产品期货市场的因素	232
第五节 农民利用农产品期货市场的途径	235
第十章 结论与建议	237
第一节 主要研究结论	237
第二节 政策建议	239
第三节 本书存在的不足	244
参考文献	246
附录	260

第一章 导 论

第一节 研究背景

“国以民为本，民以食为天”，这已是被人类社会历史证明了的真理。粮食，不仅是一般的食用商品，而且是特殊商品，因为它关乎国计民生，关乎社会的发展和稳定，关乎国家的安全。对于有 13 亿多人口的社会主义中国而言，其重要性更远远超过世界上任何一个国家。粮食问题在中国，不仅是一个经济问题，更是一个重大的政治问题。近年来，随着中国市场经济的迅猛发展和粮食体制改革的不断深入，特别是由于国际粮食形势的风云变幻，粮食安全问题日益成为政府进行宏观决策所必须考虑的重要因素之一。而期货市场以其独特的经济功能，在维护粮食安全方面能够发挥其特殊的作用。从最近十年来的几个中央 1 号文件，特别是党的十八大和十八届三中全会以及 2014 年中央经济工作会议和 2014 年中央农村工作会议可以看出，党中央、国务院一直非常重视粮食安全问题和农产品期货市场的发展。

2004 年中央下发了《中共中央国务院关于促进农民增收若干政策的意见》。文件指出，从 2004 年开始，国家全面放开粮食收购和销售市场，实行购销多渠道经营。1 号文件还指出，加快国有粮食购销企业改革步伐，转变企业经营机制，完善粮食现货和期货市场，加强粮食市场管理和宏观调控。为保护种粮农民利益，要建立对农民的直接补贴制度。

2005 年中央下发了《中共中央国务院关于提高农业综合生产能力的意见》。文件指出，要进一步抓好粮食生产，要坚持立足国内实现粮食基本自给的方针，以市场需求为导向，努力保持粮食供求总量大体平衡。保证必要的粮食储备，维护粮食市场的稳定。在继续搞好集贸市场和批发市场建设的同时，注重发挥期货市场的引导作用。

2006 年中央下发了《中共中央国务院关于推进社会主义新农村建设的若干意见》。文件指出，确保国家粮食安全是保持国民经济平稳较快增长和

社会稳定的重要基础。必须坚持立足国内实现粮食基本自给的方针，稳定发展粮食生产，持续增加种粮收益，适度利用国际市场，积极保持供求平衡。保持合理的粮价水平，保护种粮农民利益。发展农业产业化经营，发展大宗农产品期货市场和“订单农业”。

2007 年中央下发了《中共中央国务院关于积极发展现代农业，扎实推进社会主义新农村建设的若干意见》。文件指出，要促进粮食稳定发展，继续坚持立足国内保障粮食基本自给的方针，逐步构建供给稳定、调控有力、运转高效的粮食安全保障体系。加强对粮食生产、消费、库存及进出口的监测和调控，建立和完善粮食安全预警系统，维护国内粮食市场稳定。进一步规范和完善农产品期货市场，充分发挥其引导生产、稳定市场、规避风险的作用。这是中央继 2006 年提出“发展大宗农产品期货市场”和“订单农业”后，再次对我国期货市场作用的充分肯定，也为我国期货市场的未来发展定下下一步的发展目标。

2008 年中央下发了《中共中央国务院关于切实加强农业基础建设，进一步促进农业发展农民增收的若干意见》。文件指出，要高度重视发展粮食生产，切实稳定粮食播种面积，优化品种结构，提高单产水平，确保粮食生产稳定发展。积极发展稻谷生产，扩大专用小麦播种面积，合理引导玉米消费。加强农村市场体系建设，完善农产品期货市场，积极稳妥发展农产品期货品种。

2008 年 10 月 9 日中央发布了《中共中央关于推进农村改革发展若干重大问题的决定》。文件指出，粮食安全任何时候都不能放松，必须常抓不懈。加强农产品期货市场建设。

2008 年 12 月 31 日，中央下发了《中共中央国务院关于 2009 年促进农业稳定发展农民持续增收的若干意见》。文件指出，稳定粮食播种面积，优化品种结构，提高单产水平，不断增强综合生产能力。

2009 年 12 月 31 日，中央发布了《中共中央国务院关于加大统筹城乡发展力度 进一步夯实农业农村发展基础的若干意见》，文件指出，要稳定发展粮食等大宗农产品生产，在稳定粮食播种面积基础上，大力优化品种结构，着力提高粮食单产和品质。全面实施全国新增千亿斤粮食生产能力规划，尽快形成生产能力。要健全农产品市场体系，加快发展农产品期货市

场，逐步拓展交易品种，鼓励生产经营者运用期货交易机制规避市场风险。

2010年12月31日，中央发布了《中共中央国务院关于加快水利改革发展的决定》，文件指出，水利是现代农业建设不可或缺的首要条件，是经济社会发展不可替代的基础支撑，是生态环境改善不可分割的保障系统，农田水利建设滞后是影响农业稳定发展和国家粮食安全的最大硬伤。从根本上改变靠天吃饭的局面、持续提高农业综合生产能力，首先要夯实农田水利这个基础。

2011年12月31日，中央发布了《关于加快推进农业科技创新持续增强农产品供给保障能力的若干意见》，文件指出，要毫不放松抓好粮食生产，保障农产品有效供给，首先要稳住粮食生产，确保不出现滑坡。要切实落实“米袋子”省长负责制，继续开展粮食稳定增产行动，千方百计稳定粮食播种面积，扩大紧缺品种生产，着力提高单产和品质。继续实施全国新增千亿斤粮食生产能力规划，加快提升800个产粮大县（市、区、场）生产能力。要创新农产品流通方式，充分发挥农产品期货市场引导生产、规避风险的积极作用。

2012年12月31日，中央发布了《中共中央 国务院关于加快发展现代农业 进一步增强农村发展活力的若干意见》，意见指出，要稳定发展农业生产，粮食生产要坚持稳定面积、优化结构、主攻单产的总要求，确保丰产丰收。继续开展粮食稳定增产行动，着力加强800个产粮大县基础设施建设，推进东北四省区节水增粮行动、粮食丰产科技工程。支持优势产区棉花、油料、糖料生产基地建设。要提高农产品流通效率，加强农产品期货市场建设，适时增加新的农产品期货品种，培育具有国内外影响力的农产品价格形成和交易中心。

2013年12月31日，中共中央、国务院印发《关于全面深化农村改革加快推进农业现代化的若干意见》，文件指出，要抓紧构建新形势下的国家粮食安全战略，把饭碗牢牢端在自己手上，是治国理政必须长期坚持的基本方针。综合考虑国内资源环境条件、粮食供求格局和国际贸易环境变化，实施以我为主、立足国内、确保产能、适度进口、科技支撑的国家粮食安全战略。任何时候都不能放松国内粮食生产，严守耕地保护红线，划定永久基本农田，不断提升农业综合生产能力，确保谷物基本自给、口粮绝对安全。更

加积极地利用国际农产品市场和农业资源，有效调剂和补充国内粮食供给。要加强农产品市场体系建设，健全大宗农产品期货交易品种体系。加快发展主产区大宗农产品现代化仓储物流设施，完善鲜活农产品冷链物流体系。

2014 年中央经济工作会议提出了 2014 年经济工作的主要任务，其中“切实保障国家粮食安全”首次跃升为六大任务之首，粮食安全亦首次被提至“国家战略”高度。会议指出，要切实保障国家粮食安全，必须实施以我为主、立足国内、确保产能、适度进口、科技支撑的国家粮食安全战略。要依靠自己保口粮，集中国内资源保重点，做到谷物基本自给、口粮绝对安全。更加注重农产品质量和食品安全，转变农业发展方式，抓好粮食安全保障能力建设。

我国粮食安全最基本的工作是在粮食生产、流通与消费之间进行有效平衡。涉及的具体工作主要包括三项：一是国内的粮食生产和供给，二是国内的粮食储备和轮换，三是粮食进出口的调剂。但我国在这三个方面都存在一定的问題。粮食的生产具有生产周期长，受自然条件和市场需求影响大，不确定因素多等特点，根据蛛网理论和现实情况分析，粮食产量和价格容易波动，农民对粮食的种植调整是根据现货市场的价格进行决策的，由于现货价格具有滞后性，多了减，少了赶，所以总是要比市场慢一拍，无法走在现货市场的前面，这样不仅会使农民遭受较大的市场风险，还会引起粮食产量的较大波动，危及粮食安全。粮食产量和价格的波动使得农民的收入具有很强的不稳定性，影响了他们种粮的积极性。在农业产业化生产过程中，“什么赚钱种什么”之所以是一种低效益的短期行为，关键问题也是生产者依据的是现行市场价格信息，从而导致未来的市场风险。“订单农业”是我国农业产业化的重要组织形式，但其内在的缺陷依靠现行体制是无法解决的。粮食直接补贴涉及补贴价格的确定问题，目前补贴价格的确定主要是以当时的现货市场价格为参照，这个价格并不能反映其真实的价格，这样可能就会存在过高或过低的问题。过高既有可能向农民作出错误的信息引导，导致粮食价格和产量的波动，又会加大财政负担；过低又会违背补贴的初衷，取不到补贴的预期效果。就目前的粮食流通体制来讲，可谓是旧的割据已经打破，新的格局尚未形成，市场体系不健全，信息不畅通，主体不成熟，宏观调控不力等，这些问题所导致的粮食流通不顺，会造成粮食供求的结构性矛盾，引

发局部甚至全局性的粮食不安全。粮食储备的运营机制和运作方式仍未跳出传统的计划思路,吞吐机制不灵活,宏观调控效率低。如何规避储备粮轮换风险,实现储备粮的“推陈储新”,保证其库存的数量真实、质量良好和吞吐灵活,已成为目前中央以及省级储备粮经营管理中亟待解决的大问题。同时,中国加入 WTO 后,中国农产品市场开放度提高,这是否会危及到中国的粮食安全,中国应采取怎样的粮食进口战略而又不违背 WTO 的规则,在增加国内粮食生产的基础上,如何灵活、合理地运用贸易手段实现国内粮食安全,一直是理论界和决策部门高度重视的一个重要问题。而且,随着粮食购销市场化改革的深入,粮食的供求关系和粮食流通将由市场来调节,但是在粮食购销市场放开以后,相应的粮食市场体系(包括农产品期货市场和农产品批发市场,特别是农产品期货市场)并没有相应地完善,市场流通体制不畅,国家对粮食的宏观调控能力较弱,从而容易导致粮食产量和价格的波动。

本书选题正是基于上述背景,所要回答的基本问题是,在粮食购销市场化的环境下,如何在稳定粮食生产和粮食价格、完善粮食流通体制和国家粮食储备制度、改善粮食国际贸易、增加农民收入、提高政府宏观调控的能力等方面,进一步发挥农产品期货市场的经济功能,为保障粮食安全提供一个新的角度和思路。这也正是本书的研究目的所在。显然,对以上问题的回答,无论在理论上还是在实践方面,均具有重要意义,尤其是在进一步深化粮食购销市场化改革的新形势下,对于突破传统的研究粮食安全问题的思路,用新的角度来研究和保障中国的粮食安全具有重要的参考价值。

第二节 基本概念界定

本书涉及较多概念,下面对其中的重要概念加以界定和必要解释。

一、农产品期货市场的基本概念界定

(一) 期货

期货(Futures)是指在交易成立时,交易双方按照约定日期实行交割(转手)的商品、外汇、利率或证券。

（二）期货合约

在经济学概念中，期货与期货合约往往是联系在一起的，在大多数场合，期货通常就是指期货合约，因此，本书在这里对这两个词的用法也不加区分。但严格地说，二者还是有一定区别的。期货合约（Futures Contract）是指买卖双方在交易所达成的标准化的、受法律约束、并规定在将来某一特定时间和地点按照双方实现所约定的交易条件交换某一特定商品的合约。

（三）期货市场

期货市场（Futures Market）概念有狭义和广义之分。狭义的期货市场是指进行期货交易的场所。广义的期货市场是指期货买卖关系的总和。即在现代市场经济条件下，在一定的时间和空间范围内，市场交易者之间的期货合约（即未来清算的标准化的共同契约）的买卖关系及其意志行为的总和，包括构成期货市场交易的全部因素。本书中，主要涉及广义的期货市场概念。

（四）现货市场

现货市场（Cash Market）是指进行现货商品买卖交易的市场，它是现货交易中所有交换关系的总和。而现货交易是指一种买卖双方在成交后立即或在某个远期日进行商品交割和货款收受的商品交易方式。

（五）农产品期货市场

期货市场最先产生于农产品市场，农产品期货（Agricultural Futures）成为最早上市的期货品种，经过一百多年的发展，农产品期货交易品种不断扩大，至今已形成以下几大类：一是谷物类，包括玉米、燕麦、小麦、大麦、大米、黑麦等；二是油料作物类，包括棉花、大豆、大豆油、大豆粉、豆粕、菜籽油、橙汁、可可、咖啡、糖等；三是畜产品类，包括猪肚、活猪、活牛、小牛、猪腩、冻鸡、羊毛等；四是林产品类，包括木材、板材、天然橡胶等。其中，大豆、玉米、小麦是最主要的三大农产品期货。

二、粮食安全的基本概念界定

（一）粮食的概念

粮食是人类生存的必需品，也是一项重要的战略物资，因此，粮食问题