

王伟国 著

我国棉花价格预警

研究



中国农业出

石河子大学经济与管理学院“农林经济管理”重点学科建设项目资金资助
石河子大学棉花经济研究中心出版基金资助

我国棉花价格预警研究

王伟国 著

中国农业出版社

图书在版编目 (CIP) 数据

我国棉花价格预警研究 / 王伟国著. —北京: 中国农业出版社, 2014. 7

ISBN 978-7-109-19376-5

I. ①我… II. ①王… III. ①棉花—价格—经济预测—研究—中国 IV. ①F724.722

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2014) 第 152559 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 闫保荣

中国农业出版社印刷厂印刷 新华书店北京发行所发行
2014 年 10 月第 1 版 2014 年 10 月北京第 1 次印刷

开本: 880mm×1230mm 1/32 印张: 4.25

字数: 100 千字

定价: 18.00 元

(凡本版图书出现印刷、装订错误, 请向出版社发行部调换)

摘 要

在社会主义市场经济建设过程中,以价格为核心的市场机制对资源配置将起着越来越重要的作用。棉花作为我国重要的农作物,也是重要的工业原料,棉花价格是棉花行业发展乃至国民经济运行中的重要经济变量,棉花价格过低或过高都会对棉花产业及国民经济系统稳步持续发展产生不良影响。本研究从我国棉花生产、消费、国际贸易及价格概况描述入手,通过我国棉花价格的景气预警分析、棉花价格波动预测分析、预警信号分析等系统研究,对我国棉花价格走势及安全状况进行了全面、系统地探讨,并根据我国棉花价格面临的潜在不安全因素,从正确认识我国棉花价格风险、建立跨部门的工作机制、构建棉价风险预警和管控措施、提升棉花质量、加快纺纱服装技术革新、国家扶持等视角,系统地提出了我国棉花价格风险防范的对策建议。

实证分析表明:①供求矛盾一直是导致我国棉花价格周期波动的直接原因,但是,不同时期我国棉花供求矛盾成因不同。1991—1995年主要归因于国家鼓励棉花生产政策变化;1996—2003年主要归因于棉花市场

流通体制改革、亚洲金融危机、国际棉花市场动荡等因素；2004—2010年主要归因于国家宏观调控政策、全球金融危机、贸易摩擦、美元贬值，及后期国内外棉花市场流动性资本泛滥、恐慌抢购心理预期等因素；目前主要归因于欧债危机影响棉纺织品国际市场销售形势短期内很难改善、受国内临时收储政策影响国内外棉花价差高居不下、国内棉花库存持续攀升等因素。②2012年以后我国棉花价格波动幅度明显变小，未来2~3年内我国棉花价格指数也将相对比较稳定，可能会在2013年后两个季度至2014年第一季度出现小幅下滑，而后又会出现小幅上扬，并于2015年下半年出现小幅下滑。这主要归因于我国当前及今后一段时间执行的棉花临时收储价格的宏观调控政策，这一政策的出台不但有效地稳定了我国棉花价格，避免价格的大幅下跌，从而稳定了棉花生产的积极性，同时将更有效地逐步实现国内棉花价格与国际棉花价格的接轨。③虽然，目前我国棉花价格比较稳定，但是仍然存在诸多不安全因素，如受欧债危机影响，世界经济复苏步伐明显放缓，全球棉纺织工业发展依然萎靡不振，我国棉纺织工业也面临同样的困境，出口困难，致使国内棉花需求持续滑坡，同时为了维护棉农利益，国家出台了高于国际棉价的国内临时收储价，以稳定国内棉花价格，使国内棉花产量维持平稳，结果导致国内棉花市场出现较严重的供过于求，国内外棉花价格价差过大，国内棉花库存消费比过

高，国内棉花贸易依存度过大，最终带来国内棉花价格潜在的不安全因素过多，引起棉花价格的安全性降低，故我国棉花市场抵御国际市场风险的能力依然较弱。

鉴于此，要想保障我国棉花价格的安全，实现我国棉花市场稳定发展，必须：①建立预警机制，实施风险管理，加强政府宏观调控；②严格执行棉花市场准入制度，防范、堵截热钱进入棉花现货市场；③加强对棉花期货市场的管理，严格执行“涨停板”和“跌停板”制度；④建立棉花购、销（消）、存，数据报告制度，防止棉花囤积聚奇；⑤建立棉价风险平抑基金，由国家制订政策，棉花经营企业、纺纱织布和服装纺织品生产企业在税前按销售总额的一定比例提取；⑥创新推广优良品种与生产技术，鼓励纺纱织布、服装纺织品生产企业技术升级、新产品研发，为应对棉价风险提供支撑；⑦建立跨部门的工作机制，组建由国家有关部门、产业链有代表性和影响大的经济实体和行业自律组织参加的机构，调控棉价波动和棉花供求矛盾；⑧加强国家扶持，提升棉花产业的核心竞争力，培育棉花产业持续发展的效率优势。

目 录

摘要

第一章 我国棉花生产、需求及价格概况	1
一、棉花产量及地区布局	1
二、棉花需求	4
三、棉花进出口	8
四、棉花价格	9
五、棉花质量	13
六、小结	15
第二章 我国棉花价格预警指标体系的构建	16
一、棉花价格预警指标体系的初步选择	17
二、棉花价格周期循环波动类型的确定及 判断	20
三、基准循环及基准日期的确定	27
四、预警指标的分类与筛选	29

第三章 我国棉花价格预警指数的编制及 应用分析	37
一、我国棉花价格预警扩散指数的编制及应用	38
二、棉花价格预警合成指数的编制及应用	46
三、我国棉花价格循环波动的成因分析	53
第四章 我国棉花价格走势预测及波动分析	63
一、预测方法简介	63
二、预测模型的构建、估计及检验	65
三、棉花价格走势的预测及波动分析	76
四、棉花价格其他预测方法探讨	79
第五章 我国棉花价格安全预警信号系统的 构建及应用分析	89
一、棉花价格安全预警信号系统的构建	89
二、我国棉花价格安全的预警分析	102
第六章 我国棉花价格风险防范的对策建议	106
一、正确认识我国棉产业的重要性、棉花 价格风险	107
二、完善棉价风险预警和管控措施	110
三、创新推广优良品种与生产技术，提高 植棉经济效益	112

四、鼓励纺纱织布、服装纺织品生产企业	
技术升级、新产品研发	114
五、整合各方资源，建立跨部门的工作机制	115
六、建立棉花价格风险应对机制，需要国家	
给以更多的扶持	116
参考文献	118
后记	122

第一章 我国棉花生产、需求 及价格概况

经过近 20 多年来的经济快速发展，目前我国已是世界上最大的棉花生产国与消费国。本章主要简要描述我国棉花生产总量及地区布局、纺织需求总量及结构、棉花国际贸易和价格等概况，为后续章节分析奠定基础。

一、棉花产量及地区布局

（一）棉花产量

1991 年至今，整体上看，我国棉花产量呈现出明显的增长趋势，棉花生产能力显著提升，具体见图 1-1。但是，棉花生产不是呈直线增长或指数曲线增长，而是时高时低的曲折增长过程，最突出的特征是波动性大，致使生产相对过剩或需求紧张的问题交替出现。这一特点在市场化程度较大的 2000—2010 年表现最为突出。主要原因：一方面，棉花生产本身是自然再生产，周期性长（1 年），自然风险大，受灾频率高；另一方面，棉花生产是经济再生产，而且是商品率较高

的农产品，对市场走势和政策变化都极为敏感，尤其是价格水平是影响棉花生产波动的最主要因素。

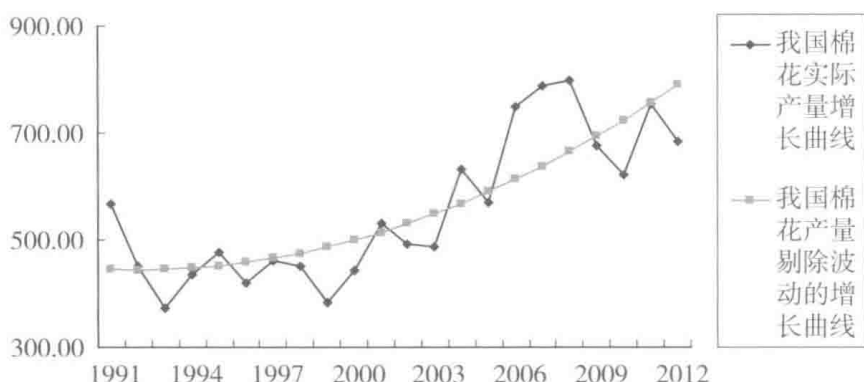


图 1-1 我国棉花总产量增长曲线（万吨）

具体来看，1991—2000 年我国棉花生产能力比较稳定，生产量大部分时间在 400 万~500 万吨之间波动；2001—2008 年我国棉花生产能力迅速提升，生产量从 2000 年的 441.68 万吨快速增长到 2008 年的 799.12 万吨，增加了 80.92%；2009 年以后，受世界金融危机、欧债危机等国际经济不景气因素的影响，国际市场棉纺织产业发展低迷，严重波及我国棉纺织产业发展，我国棉纺织品、服装出口严重下滑，导致国内棉花生产出现滑坡，但是在国家及时出台临时收储价的宏观政策调控下，国内棉花生产近两年基本维持在 700 万吨左右。

（二）棉花生产地区分布

中国 23 个省份种植棉花，但产量较大的主产棉省

份只有 10 多个。这些棉花种植区域一般划分三大地区：黄淮海棉区、长江上中游棉区和新疆棉区。

1. 黄淮海棉区

黄淮海棉区处于北方平原，由长城脚下的河北省由北向南，横跨海河，一直到淮河流域的江苏北部和安徽省北部。黄淮海棉区主要包括：河北、山东、河南、陕西和山西，2012 年棉花总产量为 156.18 万吨，占全国比重为 23.66%。其中，山东省产棉 69.5 万吨，是这一地区的第一产棉大省。黄淮海棉区春季气候干燥，棉花生产大多需要灌溉；年降雨量主要集中在夏季；秋季收获季节天气又往往比较干燥。冬小麦是黄淮海地区棉花生产的轮作农作物，玉米是主要替代竞争农作物。因处于北方，黄淮海棉区一般只有 180 天的生长期，因而一般种植成熟较早的陆地棉品种。生产出来的棉花大多通过公路或铁路运往纺织企业。

2. 长江上中游棉区

长江上中游棉区主要包括四川、湖北、湖南、江苏、安徽、江苏和浙江，2012 年棉花总产量 134.23 万吨，占全国比重为 23.34%。其中，湖北产棉 53.15 万吨，是这一地区的第一产棉大省。与黄淮海棉区和新疆棉区比较，长江上中游地区降雨相对充沛。平均年降雨量超过 1 000 毫米，85% 的降雨量发生在棉花生产季节，但夏末秋初的过多降雨容易产生病虫害损害棉花质量。小麦和油菜是棉花的主要替代作物。棉花纺织企业

都处于长江沿岸，丰富的水路为棉花运输提供了便利条件。

3. 新疆棉区

新疆棉区主要包括新疆维吾尔自治区和甘肃省的西北部地区，2012年棉花总产量为359.63万吨，其中新疆为353.95万吨，占全国的53.63%。西北地区气候干旱，年降雨量低于200毫米，并且昼夜温差大，但这种干旱气候有利于抑制病虫害的发生。由于有利的气候条件，与其他棉区相比，新疆生产的棉花质量较好，而且新疆是唯一生产长绒棉的地区。新疆棉花运距长，棉花运输问题一直比较突出。近年来，70%以上的棉花要运往内地尤其是东南沿海的天津、江苏、浙江等纺织生产中心或通过这些港口出口。新疆棉花外运主要依靠兰新铁路复线，区内北疆棉花以公路运输为主，南疆棉花以区内铁路运输（单线）为主。长期以来新疆棉区棉花种植面积稳定发展，产量逐年增加，特别是经过“九五”棉花基地建设的带动，新疆棉花生产迅猛发展。从1994年起，新疆棉花生产在全国实现了总产、单产、品级、人均占有量、调出量5个全国第一。目前，新疆棉花产量已占据了全国的半壁江山。

二、棉花需求

国内棉花需求主要有三部分：纺织工业需求、农民

自留棉和絮棉、损耗及其他用棉。纺织工业需求是棉花总需求的主体，农民自留棉仅占总需求的 3%，絮棉、损耗及其他用棉仅占 5%。因此，研究棉花需求主要是研究纺织用棉需求。

（一）我国棉纺织工业对棉花的需求

棉花作为纺织工业原料，首先纺纱，然后织布印染。再次才是服装加工。因此，对棉花来说，纺纱是直接需求（织布服装对棉花的需求是派生的），纱产量高低直接关系用棉量多少，根据消费理论，纱产量即为棉花需求的收入约束。

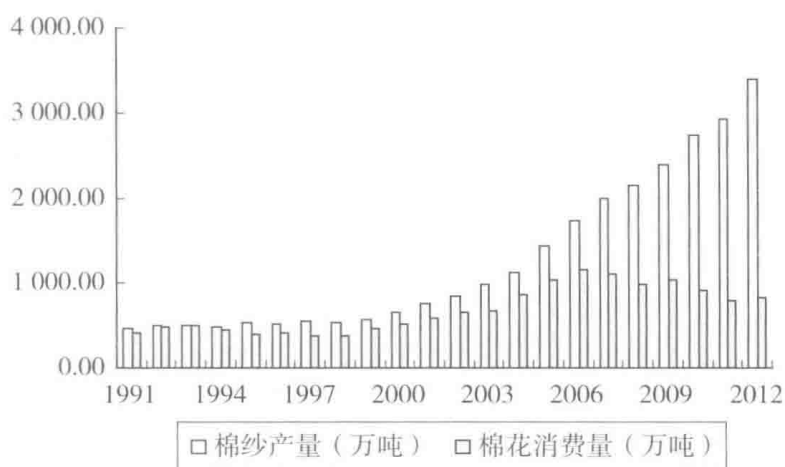


图 1-2 我国棉纱产量、棉花消费量增长曲线

图 1-2 显示，1991—2000 年我国棉纺工业发展比较平缓，棉纱（含混纺及棉型化纤纱）产量从 1991 年 460.8 万吨增加到 2000 年 657 万吨，10 年间仅增加了

不到 200 万吨,出口创汇也仅增加了 503 万美元。2001 年加入 WTO 以后,我国棉纺织工业实现了迅猛发展,产量从 2000 年的 657 万吨迅速增加到 2012 年的 3 385.44 万吨,增加了 4.15 倍,出口创汇也迅速从 694 万美元增加到 124.81 亿美元。同时,2012 年我国年生产棉布(含混纺、交织和棉型化纤布)已达 381.22 亿米,服装出口创汇高达 1 573.23 亿美元,是 1991 年 20.87 倍。目前,我国棉纱、棉布产量、服装出口量已居世界第一位。

但是,随着我国棉纺织工业的快速发展,棉花需求量并没有实现同步增长。1991—2006 年,随着棉纱产量的逐步增加,棉花消费量呈现同步增长,但是棉花消费量的增长速度明显小于棉纱产量的增长速度。2006 年以后,随着棉纱产量的逐步增加,棉花消费量呈现负增长趋势,棉花消费量从 2006 年的 1 166.66 万吨迅速下降到 2012 年的 824.9 万吨,下降了近 30%。主要原因,化学纤维是纺织天然纤维棉花的主要替代品,化学纤维在纺纱生产中的大量应用,使我国纺织用棉消费总量仍呈现逐步减少的态势。由于棉花资源短缺、国内棉花价格较高以及纺织技术的改进发展,1991 年至今,纺纱用棉比例较大幅度降低,由 1991 年的 76%下降到 2000 年的 60%左右,2001 年入世以后,又进一步下降到 2012 年的 29.8%,基本与当前国际棉纱用棉比例 30%维持一致。

（二）我国棉纺织工业的分布

我国纺织工业主要集中在长江流域一带，纺纱厂和织造厂主要集中在棉花产区。1999年，全国45%的纱产量在长江流域棉区，35.7%在黄淮海棉区，5.4%在新疆棉区，只有11%的纱生产不在棉花生产主产区。长江流域棉区的江苏省1999年纺纱产量100多万吨，是全国纺纱产量最多的省份；黄淮海棉区的山东省1999年纱产量79万吨；长江流域棉区的湖南省和黄淮海棉区的河南省纱产量也均在50万吨以上。2012年，全国49.83%的纱产量在长江流域棉区，47.22%在黄淮海棉区，1.31%在新疆棉区。可见，虽然长江流域棉区和黄淮海棉区的棉花生产量在迅速减少，但是棉纺织工业比重在增加，而棉花产量占据全国半壁江山的新疆棉纺织工业比重在减少，目前纱产量不到全国的2%。因此，大部分新疆棉区（西北地区）的棉花运向东部地区加工纺纱。长江流域纱产量占全国的比例（49.83%）远超过其棉花生产比例（23.34%），黄淮海棉区纱产量占全国的比例（47.22%）也远超过其棉花生产比例（23.66%），而新疆棉区棉花生产占全国的比例（53.63%）远超过其纱产量的份额（1.31%），这表明新疆棉区生产的大量棉花运向长江流域和黄淮海棉区用于纺纱。因此，根据原产地理论，新疆有发展棉纺织工业的绝对优势。

三、棉花进出口

当国内棉花丰收、供大于求的情况下，棉花出口对于调节供求关系、保护棉农的生产积极性、稳定棉花生产发挥了积极作用，也使我国棉花在国际市场上占据了一席之地。同时，由于棉花生产的特殊性，导致棉花产量的不稳定、不确定性，国内棉花生产很难完全保证国内的实际消费需求，因而，进口一定数量的棉花、合理利用国际棉花资源，将是保证国内棉花需求的重要手段和杠杆，对于稳定纺织工业生产、保障人民纺织消费需求、扩大我国纺织品出口创汇规模乃至保证社会安定均具有十分重要的意义。

我国作为世界的棉花生产和消费大国，中国棉花进出口贸易不仅对国内棉花生产和纺织工业的发展起到十分重要的作用，在国际棉花贸易中也占有举足轻重的地位。1991—2000年，我国净出口和净进口国的地位交替出现，具有明显周期性；2001年至今，我国成为棉花净进口国，净进口量基本维持在250万吨左右，基本占我国棉花总消费的30%（图1-3）。近年来，我国成为棉花净进口国主要归因于入世的协定，一是我国已取消棉花出口补贴，由于我国棉花生产成本较高，取消补贴很难实现棉花出口，不可能通过棉花出口来调节国内棉花供求平衡；二是必须用足协定棉花进口配额，导致国内棉花进口量居高不下，国家利用进口来调节国内棉