

上海市教委重点学科金融学建设

项目资助 (J512-01)

R 我国大宗商品政府管制 方法及策略研究

research on method and strategy of commodities
regulation in China

仰 炬◎著



经济管理出版社
ECONOMY & MANAGEMENT PUBLISHING HOUSE

上海财经大学出版社
ISBN 7-309-04749-9

我国大宗商品政府管理 方法与策略研究

methodological and strategy of commodity
management in China

陈 宇 著

上海财经大学出版社

R 我国大宗商品政府管制 方法 及 策略研究

research on method and strategy of commodities
regulation in China

仰 炬●著



经济管理出版社
ECONOMY & MANAGEMENT PUBLISHING HOUSE

图书在版编目 (CIP) 数据

我国大宗商品政府管制方法及策略研究/仰炬著. —北京: 经济管理出版社, 2010.8

ISBN 978-7-5096-1064-0

I. ①我… II. ①仰… III. ①国家干预—市场经济—研究—中国 IV. ①F123.16

中国版本图书馆 CIP 数据核字 (2010) 第 146627 号

出版发行：经济管理出版社

北京市海淀区北蜂窝 8 号中雅大厦 11 层

电话: (010) 51915602 邮编: 100038

印刷: 北京交通印务实业公司

经销: 新华书店

组稿编辑: 贾晓建

责任编辑: 孙 宇

技术编辑: 黄 铄

责任校对: 陈 颖

880mm×1230mm/32

6 印张 170 千字

2010 年 9 月第 1 版

2010 年 9 月第 1 次印刷

定价: 18.00 元

书号: ISBN 978-7-5096-1064-0

·版权所有 翻印必究·

凡购本社图书, 如有印装错误, 由本社读者服务部
负责调换。联系地址: 北京阜外月坛北小街 2 号

电话: (010) 68022974 邮编: 100836

前言

我国作为石油、铜、铁矿石、橡胶等大宗商品及大豆等农产品的世界主要进口国和包括铜、铝、钢铁、煤炭、小麦、糖、棉花、黄金、白银等在内的世界重要大宗商品的主要生产国与消费国，一方面在纺织品、鞋类等的出口方面频遭阻击，另一方面在上述这些关系国计民生的大宗商品贸易运行过程中，又屡屡损失惨重，诸如“株冶事件”、“中航油事件”、“中储棉事件”、“国储铜事件”等，单就这些事件造成的直接损失就达近百亿元。发生暂时的损失是小，但更重要的是，作为关系国计民生的大宗商品，政府管制对于大宗商品的定价有何影响？对于价格的波动性又有何影响？对于这些关系国家经济、经贸乃至国家安全的大宗商品，政府应该如何管制？针对大宗商品，相关金融市场又应该如何管制？这些都是目前国家宏观调控、政府对大宗商品管制中非常重要而又迫切需要解决的问题。

本书针对世界经济一体化、国际贸易蓬勃发展、资源全球配置等新趋势、新挑战下，我国特殊经济和体制改革时期的社会主义市场经济下政府管制的特殊性和复杂性，以关系国计民生及国家政治经济安全的大宗商品政府管制为研究标的，从三个层面逐层深入，展开系统的理论和实证研究：

(1)首先针对大宗商品政府管制的可能性展开研究，指出：政府针对大宗商品的政府管制是有可能的，但需要选择适当的时机、符合一定的前提条件。提出并用计量经济学方法证明：国内外市场不存在长期均衡是政府管制有效性的前提。

在实证研究的基础上，指出：当前我国政府针对（国内外市场尚未达到均衡的）小麦、棉花及糖的管制将有效，而试图重构（国内外

市场已经达到均衡的)石油、铜、铝、黄金、大豆、玉米市场均衡的管制可能会徒劳无益。

由此为大宗商品政府管制前评估管制有效性提供一个判断的依据,避免类似“国储铜事件”等盲目的管制决策造成不必要的负面影响和损失。

(2) 政府管制方法的有效性研究,即:政府管制的方法和策略。

本书以世界糖产业(同时具有金属属性和金融属性、特殊而又极其重要的大宗商品)、黄金及成品油的国内外政府管制方法和策略的实证研究表明,政府管制对于大宗商品的价格及波动性有着重要的影响。在分别完成(农产品)糖、(贵金属)黄金、(能源)成品油的政府管制方法和策略研究后,尝试提出我国政府有效管制大宗商品市场的一般策略和方法。在此基础上,结合国外金融市场政府管制,进一步研究了大宗商品相关金融市场的政府管制。

(3) 建立我国大宗商品政府管制系统框架。

构建宏观层面(主因素为:生产、消费、储备、进出口)大宗商品政府管制框架,并以石油为例构建了我国石油政府管制监控指标体系,由此为进一步建立完善的大宗商品政府管制体系打下基础。

针对近阶段以美国和欧盟为首的西方国家对我国展开的频繁的反倾销、反垄断调查,从大宗商品角度进行分析,认为西方国家在贸易保护的同时,利用其控制大宗商品定价权推高基础资源价格,从而削弱出口国产业竞争力,以保护其国内产业及弥补贸易保护带来的福利损失,并通过对棉花价格的实证研究证明这一观点。在此基础上,进一步分析近阶段钢管、钢绞线、紫铜管贸易争端的缘由及趋势。

大宗商品政府管制研究内容博大精深,作者尝试做了一些前期基础工作,由于作者水平有限,错漏之处,敬请同仁斧正!

目 录

第一章 绪论 / 1

第一节 研究背景及问题的提出 / 1

第二节 文献综述 / 3

第三节 研究思路 / 13

第四节 本书内容及结构安排 / 15

第二章 我国大宗商品政府管制可能性研究 / 17

第一节 引言 / 17

第二节 文献回顾及评价 / 19

第三节 研究方法、数据及统计检验 / 22

第四节 进一步的讨论 / 28

第五节 更广泛的印证及应用 / 31

第六节 本章小结 / 40

第三章 我国大宗商品政府管制方法及策略研究：以糖产业为例 / 41

第一节 引言 / 41

第二节 文献综述 / 42

第三节 研究方法、数据及统计检验 / 52

第四节 进一步的分析 / 60

第五节 本章小结 / 64

第四章 我国黄金市场政府管制策略研究 / 65

- 第一节 引言 / 65
- 第二节 文献回顾 / 67
- 第三节 研究方法、数据及统计检验 / 69
- 第四节 进一步的讨论 / 79
- 第五节 本章小结 / 86

第五章 我国成品油政府管制策略研究 / 87

- 第一节 引言 / 87
- 第二节 文献回顾及问题的提出 / 90
- 第三节 研究方法、数据及统计检验 / 91
- 第四节 进一步的讨论 / 97
- 第五节 我国大宗商品政府管制的一般策略 / 102
- 第六节 本章小结 / 104

第六章 我国大宗商品相关金融市场政府管制 / 105

- 第一节 引言 / 105
- 第二节 文献回顾 / 106
- 第三节 国外金融市场管制及启示 / 107
- 第四节 国外大宗商品相关金融市场的建设和发展 / 115
- 第五节 我国大宗商品相关金融市场管制 / 120
- 第六节 国外金融市场管制对我国大宗商品
金融市场政府管制的启示 / 126
- 第七节 本章小结 / 128

第七章 我国大宗商品政府管制监管框架 / 129

- 第一节 引言 / 129
- 第二节 文献综述 / 130
- 第三节 我国大宗商品政府管制监管框架的构建 / 134

第四节 进一步研究的问题 / 135

第八章 后危机时代贸易保护——大宗商品视角 / 139

第一节 引言 / 139

第二节 文献回顾 / 141

第三节 问题的提出 / 147

第四节 实证检验 / 149

第五节 进一步的分析 / 153

第六节 本章小结 / 164

第九章 结论与展望 / 165

第一节 本书的主要工作和结论 / 165

第二节 进一步研究的问题 / 167

参考文献 / 169

后记 / 181

第一章 绪 论

第一节 研究背景及问题的提出

经济学理论和经济发展的实践已经证明：为实现经济的均衡发展，即便在高度发达的市场经济中，政府的作用也是不可或缺的。

我国作为石油、铜、铁矿石、橡胶等大宗商品及大豆等农产品的世界主要进口国和包括铜、铝、钢铁、煤炭、小麦、糖、棉花、黄金、白银等在内的世界重要大宗商品的主要生产国和消费国，一方面在纺织品、鞋类等的出口方面频遭阻击，另一方面在上述这些关系国计民生的大宗商品贸易运行过程中，又屡屡损失惨重，诸如“株冶事件”、“中航油事件”、“中储棉事件”、“国储铜事件”等，单就这些事件造成的直接损失就达近百亿元。发生暂时的损失是小，但更重要的是，作为关系国计民生的大宗商品，政府管制对于大宗商品的定价有何影响？对于价格的波动性又有何影响？对于这些关系国家经济、经贸乃至国家安全的大宗商品，政府应该如何管？怎样的政府管制是有效的？大宗商品相关金融市场应该如何管？在当前由金融危机引发的全球经济衰退中，以欧美为首的贸易保护主义重新抬头，在目前这种新形势、新挑战下，大宗商品政府管制的方略是什么？这些都是目前国家宏观调控、政府对大宗商品管制中非常重要而又迫切需要解决的问题。

管制，源于英语中 regulation 一词，指“政府对经济行为的管理

或制约”(Kahn, 1980),“在市场经济条件下,政府为了矫正或改善市场机制内在的问题而干预经济主体活动的行为”(植草益, 1992)。我国有的学者将其译为管制,如台湾学者翻译的卡恩的《管制经济学》,余晖翻译的丹尼尔·F.史普博的《管制与市场》,冯金华翻译的小贾尔斯·伯吉斯的《管制和反垄断经济学》;也有学者将其译为规制,如朱绍文翻译日本学者植草益的《微观规制经济学》。国内外学者就政府管制领域发表的研究成果对管制经济学的研究和学科的形成产生了很大的影响(Stigler, 1971; Peltzman, 1976; Kahn, 1980; 布坎南, 1988; Hahn Robert W. & H. John, 1991; 植草益, 1992; Hahn Robert W., 1993; 余晖, 1994; S. Andrei & V. S. Cass R., 1996; Geroge A. Steiner & John F. Steiner, 1997; Richard A. Posner, 2000; Schwartz A., 2000; 王俊豪, 2001; H. Robert W. & V. S. Cass R., 2002; 陈富良, 2002; 张宇等, 2003; Skogstad, 2003; 宇燕、席涛, 2003; G. Edward & A. Shleifer, 2003; Djankov Simeon etc., 2003; Andreas, 2004; 淮建军、刘新梅, 2007; 茅铭晨, 2007; 仰炬, 2008)。

所谓管制经济学(Economics of Regulation),就是研究谁从管制得益、谁因管制受损,管制会采取什么形式,以及管制对资源配置影响的理论。大部分政府管制具有不可试验性而且有时候管制的成本非常高,而管制的结果在管制决策前是不可知的。正如施蒂格勒(1962)通过大量实证研究表明管制的实际效果大大偏离了政府的管制目标,有些管制根本无效。

相关研究文献可谓汗牛充栋,它们都为这个领域的研究做出了重要贡献,但目前的研究还存在一些缺陷和不足:

(1) 针对我国处于当前特殊经济和体制改革时期的社会主义市场经济政府管制的特殊性和复杂性,针对性研究还很不充分,理论发展落后于实际需要。目前,我国学术界对于政府什么该管、什么不该管、该管又管到什么程度、采用什么形式管等缺乏系统的理论和实证研究。

(2) 世界经济一体化、国际贸易蓬勃发展、资源全球配置等新趋势、新挑战下的政府管制方略。

(3) 对于关系国计民生及国家政治经济安全的大宗商品,目前针对其政府管制是否有效?什么情况下政府管制会有效?对于大宗商品政府应该如何管?对于大宗商品相关的金融市场又该如何管?目前的研究对这些在目前国家宏观调控、政府对大宗商品管制中非常重要而又迫切需要解决的问题还缺乏系统的理论和实证研究。

第二节 文献综述

早在古罗马时代,为实现社会公平和稳定,政府为产品和服务制定了“公平价格”。据史料记载,大约公元300年,古罗马时代戴克里先皇帝为近百种商品(在灾荒年代等特殊时期)制定最高公平价格,以避免不道德卖者囤积居奇、影响社会稳定。尽管政府并没有控制工商业企业,但社会重要物品和服务的价格完全由政府管制(Hirsh, 1999)。

一、概念界定

《新帕尔格雷夫经济学大辞典》对管制有广义和狭义两种解释,分别涉及政府干预经济的宏观与微观层面。一种解释指国家以经济管理的名义干预宏观经济,比较典型的做法就是凯恩斯提出的通过一些反周期的预算或货币调节手段对宏观经济进行调控和干预;另一种解释指政府为控制企业的价格、销售和生產决策而采取的各种行动,政府公开宣称这些活动旨在制止不被充分重视“社会利益”的私人决策。与之相对应的放松管制(Deregulation)是指20世纪70年代中期以来废除许多特定管制方案的政治运动(《新帕尔格雷夫经济学大辞典》,1996)。

作为现代管制经济学的创始人——斯蒂格勒于1962年和1971年先后发表了《管制者能管制什么——电力部门实例》和《经济管制的

理论》，为政府管制的研究作出了开创性的贡献，同时也“改变了管制研究的方向”（Peltzman, 1993）。以斯蒂格勒（Stigler, 1971）为代表的芝加哥学派认为：管制作作为一种规则，是对国家强制权的运用，是应利益集团的要求为实现其利益而设计和实施的，即所谓的政府管制的部门利益理论或称俘获理论（Theory of Regulatory Capture）；与之前一般意义上认为管制是为了克服市场失灵的规范性定义（即政府管制的公共利益理论）不同。

日本经济学家植草益认同狭义政府管制，即指政府对微观经济主体的控制或干预。伯吉斯（Burgess, 1995）认为政府管制是指政府通过修正或控制生产者或消费者的行为来达到某个特定的目的的干预。政府可以决定商品的价格、生产什么以及生产多少，在一些特殊情况下，政府管制甚至能够决定由谁生产和如何生产。各国政府比较广泛采用的市场准入制度就是典型的例证。政府通过经营许可、行业准入、质量标准、安全规范等管制措施限制商品（服务）的生产和销售。史普博认为：“管制是由行政机构制定的直接干预市场配置机制或间接改变企业和消费者的供需决策的一般规则或特殊行为。”（Spullber, 1999）史普博（1999）的定义与传统的关于微观市场失灵的界定不同，他将市场失灵细化为三种形式：阻碍性交易（进入壁垒）；缺乏合法的必备条件的交易（外部性）；产生低效率的交易（内部性）。

我国学者余晖（1997）认为，管制是指政府的许多机构以治理市场失灵为己任，以法律为依据，以大量颁布法律、法规、规章、命令及裁决为手段，对微观经济主体（主要是企业）的不完全公正的市场交易行为进行直接的干预和控制。王俊豪（2001）认为，政府管制是具有法律地位的、相对独立的政府管制者（机构）依照一定的法规对被管制者（主要为企业）所采取的一系列政管理和监督行为。茅铭晨（2007）认为，政府管制是“管制性行政主体根据法律法规的授权，为追求经济效益和社会效益的帕累托最优及维护社会公平和正义，对经济及其外部性领域和一些特定的非经济领域采取的调节、监管和干预等行政行为。从国际制度层面看，政府管制是政府管理的一项重要

法律制度”。

二、管制类型

政府管制大致可以分为两个基本类型：经济性管制和社会性管制。

1. 经济性管制

经济性管制简称经济管制，是指“对某种产业的结构及其经济绩效的直接政府规定，如进入管制、价格限制、服务条件及质量的规定以及在合理条件下服务所有客户时应尽义务的规定”（Kahn，1970）。植草益（1992）细化了上述定义，指出在自然垄断和存在信息偏差的领域，为了防止发生资源配置低效率、确保使用者的公平，政府利用立法权限，通过准入和各种规范，对企业的进入、退出、价格、服务的数量和质量、投资、财务会计等有关行为加以管制。我国学者王俊豪（2001）将经济性管制归纳为价格管制、进入和退出市场管制、投资管制、质量管制。

目前，政府管制相关研究主要集中在某些特定产业（如供水、供电、供气、供暖、通信、公路运输、铁路、航空等公用事业与金融业）的价格、进入和退出的管制等方面。

（1）价格的管制。政府为提高社会分配效率、刺激产业生产效率和维持产业发展潜力，防止可能的垄断损害消费者利益和产业正常发展，对企业实施价格控制，这种控制形式可以表现为要求企业在一定范围内定价或者为企业制定最高限价。1999年美国联邦通讯委员会为AT&T订立的长途话费上限及我国信息产业部2005年涉及长途电话、手机国内漫游话费、固话本地通话进行资费上限管理就是这方面的典型例证。对与老百姓日常生活相关的水、电、燃气、公共交通等价格，政府都有严格的价格管制。价格管制是经济性管制的核心（王俊豪，2007）。

（2）进入和退出的管制。垄断具有显著的规模效应，但又必然因缺乏自由竞争而抑制市场配置资源的能力，造成社会福利损失。这就需要政府通过控制进入和退出管制，平衡规模经济和自由竞争，调节

生产和分配效率。早期关于政府管制的研究较多地集中在垄断产业中。

价格管制有时伴随着数量管制和进入退出管制。各国政府采用较多的市场准入有颁发营业执照、制定行业质量标准及安全规范等,另一个较为典型的例子是对城市公交车和出租车运营的管制。

2. 社会性管制

社会性管制是指以保障劳动者和消费者的安全、健康、卫生、环境保护、防止灾害、产品和服务的质量以及伴随着提供它们而产生的各种活动制定一定标准,并禁止、限制特定行为的管制(植草益,1992)。社会性管制一般分为健康管制、环境管制、产品安全管制、职业安全和卫生管制等(维斯库斯、弗农,2004)。社会管制旨在限制个人、组织和政府的行为,其由涵盖范围广泛的法令、机构、行政计划构成。社会性管制的目的包括环境质量、职业安全和卫生、消费者保护和公民权利等。

20世纪70年代以来,就世界范围而言,经济管制有放松趋势,而以环境污染和环境保护、食品和药品安全等为代表的社会管制则不断加强。

三、管制理论述评

在崇尚自由竞争市场经济的资本主义国家,政府管制的初衷是为了避免“市场失灵”、实现公共利益及社会资源的有效配置。而在我国这样一个社会主义市场经济国家,政府管制有一定的特殊性和复杂性。

纵观政府管制理论的研究和发展,先后有政府管制的公共利益理论、政府管制的部门利益理论(俘获理论)、管制经济理论、激励管制理论、管制与法律的替代理论、监管型政府兴起理论及管制的成本—收益分析理论等。

1. 政府管制的公共利益理论

由于市场中供方(生产者)和需方(消费者)之间信息的不对称,而且通常情况下交易者存在着非理性,而交易又是有成本的,因

此完全依靠市场机制无法实现资源的最优配置。

管制的公共利益理论认为管制的目的在于矫正市场失灵或不公平的市场实践活动，如垄断、外部性、不完全市场、信息失灵等（斯蒂格里茨，2000）削弱竞争的市场条件可能造成社会福利的损失；而如果单纯地依靠市场配置可能带来经济机会以及结果的不平等，这就需要国家采取某种管制措施来纠正（Bonbright, 1961; Davis, 1958、1970; Fridently, 1962; Levine & Forrence, 1990; Stiglitz, 2000）。这种极端情形就是战争时期的政府对竞争的管制，比如第一次世界大战和第二次世界大战时期，很多国家政府广泛采取了针对价格和供应的管制政策，以应对商品普遍的短缺。

事实上，现实生活中公共事业（供水、供电、供暖等）以及交通运输业（公共交通、出租车等）管制，包括农业补贴、出口退税等在内的各种政府补贴、行业进入许可、质量安全标准、职业许可证、最低工资标准甚至包括关税在内的各种壁垒的设置都是政府对自由市场运行的管制。早期发生在西方市场经济国家的价格管制、反垄断措施和规定，表现出政府为了保护弱者的利益、维护公平的市场经济所作出的努力（孟延春、吴伟，2008）。从某种意义而言，主张国家采用扩张性经济政策，通过增加需求促进经济增长的凯恩斯主义也可以作为政府管制理论的一种重要形式。

波斯纳（1974）指出管制的公共利益理论有两个隐含的假定：一是市场经济是脆弱的，如果让其自由发挥作用，则可能导致无效率或不平等，政府管制可以矫正市场失灵而维护公平；二是政府管制是无成本的。管制并不必然与外部经济或外部不经济的出现以及垄断市场结构有关。正如斯蒂格勒（1962）对自然垄断产业管制的实证研究表明：管制的实际效果大大偏离了政府的管制目标，有些管制根本无效。更多研究对政府管制的绩效以及管制可以促进公平提出了怀疑（Averch & Johnson, 1962; Jordan, 1972; Joskow and Rose, 1989）。同样的，对于第二个隐含假定——“政府管制是无成本的”也只能是一种理想状态，现实中政府管制机构的设立、管制机构运转、管制的执行等都可能带来高额的成本，这里尚且不考虑政府制定管制政策及

管制执行后可能的“失灵”带来的巨大成本和社会负面影响。

此外，管制的公共利益要求政策制定者和执行者——政府管制机构及其中的工作人员大公无私并始终将社会公共利益放在首位。而在现实社会中，政府官员也是社会中普通的、理性而自利的经济人，并不因为成了政府官员就发生质的改变。管制的公共利益理论在解释其中的运作和机制设计过程中存在一些客观的挑战。

2. 政府管制的部门利益理论（俘获理论）

与公共利益理论相对的是管制行为的部门利益理论或称俘获理论（Theory of Regulatory Capture）。该理论基于管制政策制定者的自利性。

部门利益理论（俘获理论）认为管制者常常被“受管制的集团”所俘获，为了保持官位或追求再次当选，利用职务便利为自己和利益往来的特殊集团谋取私利，为这些利益集团服务，而获利的集团则通过投票或其他的方式（如赞助）支持这些政策制定者以回报政府官员。

政府管制的现代俘获理论是由安东尼·唐斯（1957）和奥尔森（1965）提出的，其后被梅赫尤（1974）系统地运用于政府立法行为研究中，本特利（1908）、特鲁曼（1951）、斯蒂格勒（1962、1971）、波斯纳（1974）、佩尔兹曼（1976）、贝克尔（1983）、麦克肯斯尼（1987）、蒂索托（1990）、施莱佛和维什尼（1993）、麦克库宾斯（1999）、克若雷（2000）等学者不断发展政府管制的俘获理论。

斯蒂格勒（1962、1971）开创性地使用经济学的供求分析框架分析管制的供给与需求，建立了行业经济管制效果经验分析方法（Joskow and Rose, 1989），提出管制是由产业争取而来并为产业利益服务的观点，并概括了管制的形式：第一，产业争取政府补贴和扶持；第二，向政府寻求进入管制，以保护已有的市场份额和市场地位，指出政府管制与其说是保护消费者免受剥削，不如说是保护了生产者免受竞争的压力，并对不同的利益集团的收入进行了重新分配。

佩尔兹曼（Peltzman, 1976）在斯蒂格勒研究的基础上进一步发展了管制的政治模型。佩尔兹曼假定政府管制过程的成本不仅限制了