上海钢联铁矿石价格 2023 年度自我评估报告

按照《重要商品和服务价格指数行为管理办法（试行)》(以下简称“《办法》”）和《价格指数行为评估和合规性审查操作指南》的规定，上海钢联电子商务股份有限公司对所编制的铁矿石相关价格指数开展了自我评估，评估结果符合《办法》要求。

一、价格指数行为主体

上海钢联(Mysteel)是从事大宗商品及相关产业数据服务的独立第三方资讯机构，不参与市场交易。

目前上海钢联铁矿石价格体系主要覆盖进口矿与国产矿两个不同的方向，涉及到粗粉、精粉、球团和块矿等不同呈现状态的铁矿石。根据市场使用场景，铁矿石价格行情分为港口现货市场价格、远期现货市场价格和国产矿相关价格等类型。

1.上海钢联独立于价格指数所反映的商品或服务市场的直接利益相关方，并对外公开声明接受监督

上海钢联（SZ.300226）是全球领先的大宗商品及相关产业数据服务商。作为独立第三方机构，上海钢联构建了以价格为核心的多维度数据体系，主要为产业客户提供决策支持，在现货与商品衍生品市场均取得了广泛认可与应用。

上海钢联是国际证监会组织（IOSCO）金融基准原则的合规认证企业，接受国内与国际监管机构的监督。

2.有合法稳定的价格信息来源

深耕大宗商品行业二十余年，上海钢联建立了稳定畅通的价格信息采集渠道。为了保证价格采集的合法稳定，上海钢联编制了一系列的政策文件，同时搭建了严格的管控流程。主要有《提交者审核过程政策》、《提交者行为准则》与《数据提交协议》等。上海钢联每年都会通过邮件发送以上资料为提交者进行培训并签订数据提交协议，明确规定了作为价格行为主体的上海钢联与提交者双方的义务与权利。

3.有必备的组织架构，专业人员和设施

上海钢联价格指数的编制有必备的组织架构，专业人员和设施。

上海钢联组建了指数管理委员会，作为指数团队的最高管理机构，下设指数工作组、指数研发部和指数合规部。

上海钢联价格指数团队成员具有多年的行业经验，能够胜任价格采集、价格计算、审核及相应的基本工作。除此之外，上海钢联还制定了《内部培训政策》，定期为指数组所有员工进行体系化的培训，培训的内容主要分为基础知识、规章制度和指数管理。

上海钢联自建了 OA 呼叫系统，每个通过电话采集的价格均可追根溯源，便于价格工作标准化管理、录音存档、规范采集。同时上海钢联拥有自己的网盘，所有价格指数相关的留痕都在网盘上进行，并根据职责设定相关查看和编辑的权限。

4.有完备的内部控制流程以及投诉渠道和处理机制

上海钢联搭建了完备的内部控制流程。为保证价格指数的高质量运行，上海钢联建立了从市场调研、样本库建立、数据采集、离群值剔除、验证、标准化入库、指数计算到指数发布一整套完备的内部控制流程。

上海钢联制定了《利益冲突政策》、《利益冲突内部控制流程》等政策。明确规定了价格指数团队人员的薪酬保持在相对较高的水平，绩效考核、职务晋升等不与价格指数的表现水平挂钩。

上海钢联制定了《投诉政策》和《投诉处理过程》，详细说明了接收和调查有关上海钢联价格指数确定过程的投诉程序，并设立了电话、邮件与信件等三个投诉接收渠道，以保证投诉渠道畅通。

截止 2023 年底，上海钢联铁矿石价格指数团队暂未收到任何与铁矿石价格相关的投诉。如果收到相关的投诉，将严格按照《投诉政策》和《投诉处理过程》的政策要求进行处理。

二、价格指数的编制方案完整性和科学性

1. 有规范的价格指数名称，阐明价格指数的编制背景和目的，清晰界定所反映的对象和范围

上海钢联在价格指数的编制过程中有规范的价格指数名称，阐明价格指数的编制背

景和目的，清晰界定所反映的对象和范围。对于信息采集点覆盖的相应商品或服务市场交易规模在该区域市场中的占比，以及该覆盖面能够准确有效地反映该区域市场价格情况，上海钢联设计了《价格指数代表性数据统计》和《价格信息采集点及交易量统计》两个表格，表格内容涵盖了信息采集点覆盖的市场交易量及占比，并在《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》进行具体的细化描述和公开披露。

（1）规范的价格指数名称

上海钢联严格按照《重要商品和服务价格指数行为管理办法（试行）》的要求，不存在使用冠以“中国”、“国家”、“全国”、“中华”等字样的价格指数名称,起草并发布了企业内部规范《价格表单标准格式的管理办法》。如：价格名称：Mysteel XXXX 铁矿石价格行情。

图 1.价格类表单名称

2023年10月23日(17:50)青岛港铁矿石价格行情

2023-10-23 17:52:19 来源：我的钢铁 | 价格中心>>

分享到: 手机看价格 资讯监督 打印 复制链接

品名(中文) 请筛选	参考品位 请筛选	来源国/供应商 请筛选	价格(元/湿吨)	涨跌	分类 请筛选	备注
当前筛选						
PB粉	61.5%	Rio Tinto	903	-5	粉矿	
PB块	62.5%	Rio Tinto	1108	-7	块矿	
纽曼粉	62.5%	BHP	919	-5	粉矿	
纽曼块	63.0%	BHP	1087	-11	块矿	
纽曼筛后块	63.0%	BHP	1089	-11	块矿	
麦克粉	61.0%	BHP	891	-5	粉矿	
金布巴粉	60.5%	BHP	865	-10	粉矿	
金布巴粉	59.5%	BHP	855	-10	粉矿	
罗伊山粉	61.0%	Royhill	873	-5	粉矿	
罗伊山块	62.0%	Royhill	993	-7	块矿	
印度球团	63.0%	印度	1070	-5	球团	
卡拉加斯粉	65.0%	Vale	990	-3	粉矿	
巴混（BRBF）	62.5%	Vale	918	-5	粉矿	
巴混（BRBF）	63.0%	Vale	923	-5	粉矿	
巴粗（SSFG）	62.0%	Vale	870	-5	粉矿	(#)

图 2. 指数类表单名称

2023年6月12日Mysteel铁矿石远期现货价格指数

2023-06-12 18:53:23 | 来源：我的钢铁 | 价格中心>>

分享到： 手机看价格 资讯监督 打印 复制链接

2023年6月12日，Mysteel铁矿石远期现货指数信息采集点共59个，样本总数146个，成交量26万吨。样本数量百分比（非权重）：成交数据占比3%，可成交数据占比45%，询报盘数据占比52%，无主观判断。其中Mysteel62%澳粉指数样本标准化后的最高值为112.36，最低值为109.61，平均值为110.98，相关样本范围均符合Mysteel铁矿石价格指数方法论要求。

名称 请筛选	品位 请筛选	产地 请筛选	价格	涨跌	备注
当前筛选					
澳洲粉矿	62.00%	澳大利亚	111.15	-3.75	
低铝粉矿	62.00%	不限	112.95	-4.45	
澳洲粉矿	58.00%	澳大利亚	101.55	-3.75	
巴西粉矿	65.00%	巴西	122.75	-4.55	
65%精粉	65%	不限	117.75	-4.1	
66%精粉	66%	不限	122.45	-4.1	
印度球团	63.00%	印度(*)	119.3	-3.75	
块矿溢价	62.50%	澳大利亚	0.123	-0.0055	美元/干吨度
纽曼块溢价	63.00%	澳大利亚	0.123	-0.0055	美元/干吨度
乌克兰/俄罗斯球团溢价	65.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	12.2	+0.8	基于65%指数
乌克兰/俄罗斯球团溢价	65.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	18.25	-0.15	基于62%指数
印度球团溢价	63.00%	印度(*)	6.05	-	基于62%指数
乌克兰/俄罗斯球团溢价	63.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	6.85	-0.05	基于62%指数

为保证上海钢联价格的市场代表性，我们有详尽的市场调研报告。完成市场调研后才会进行价格设计和编制，确保研发的价格符合市场逻辑，并且我们设计了《铁矿石价格指数代表性数据统计》和《样本采集点统计》（见下图），并且在《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》中第 28-43 页进行了披露

以青岛港市场为例，2023 年青岛港铁矿石到港量 1.028 亿吨（来自钢联数据统计），Mysteel 青岛港铁矿石价格行情采集样本企业 205 家，如厦门国贸、世纪瑞丰、中信泰富特钢等，区域内样本总数 215 家，占比达到 95.3%，因此 Mysteel 所发布的青岛港铁矿石价格行情能够真实准确反映市场的实际运行情况。

图 3 样本采集点统计（远期现货与港口现货）

附录 C1：样本采集点统计（远期现货市场）（排名无先后，按首字母排序）

序号	企业名称	企业类型
1	富曼拓新加坡股份有限公司	贸易商
2	瑞迪因金属资源有限公司	贸易商
3	RWE	贸易商
4	Star Global	贸易商
5	UNICORE RESOURCES PTE LTD	贸易商
6	宝矿国际贸易有限公司	贸易商
7	唐山首钢宝业钢铁有限公司	贸易商
8	北京融时代国际贸易有限公司	贸易商
9	北京来巍有限贸易公司	贸易商
10	第一资源（香港）发展有限公司	贸易商
11	大陆矿业有限公司	贸易商
12	湖南德天集团	贸易商
13	东铭矿业（福建）有限公司	贸易商
14	上海富驰贸易有限公司	贸易商
15	广东物资产业有限公司	贸易商
16	国创资源有限公司	贸易商
17	河北敬业钢铁有限公司	贸易商
18	华中矿业（集团）有限公司	贸易商
19	冀东发展集团国际贸易有限公司	贸易商
20	嘉吉投资（中国）有限公司	贸易商
21	嘉能可斯特拉塔股份有限公司	贸易商
22	山东建邦联合进出口有限公司	贸易商
23	北京建邦兴业国际矿产资源有限公司	贸易商
24	江苏艾仕腾国际贸易有限公司	贸易商
25	杰拉德金属（上海）有限公司	贸易商
26	景泽（北京）国际贸易有限公司	贸易商
27	开滦（香港）国际贸易公司	贸易商
28	青岛联合同创矿业有限公司	贸易商
29	上海美恺国际贸易有限公司	贸易商
30	上海美匡供应链管理有限公司	贸易商

附录 C2：样本采集点统计（港口现货市场）（排名无先后，按首字母排序）

序号	企业名称	企业类型
1	埃珂森(上海)企业管理有限公司	贸易商
2	中航国际钢铁贸易有限公司	贸易商
3	宝航资源(天津)有限公司	贸易商
4	宝矿国际贸易有限公司	贸易商
5	北京来龙国际贸易有限公司	贸易商
6	北京荣丰嘉华贸易有限公司	贸易商
7	北京融时代资产管理有限公司	贸易商
8	嘉吉投资(中国)有限公司	贸易商
9	承德市紫石矿业有限责任公司	贸易商
10	诚信恒远国际贸易有限公司	贸易商
11	中国矿产资源集团有限公司	贸易商
12	中国五矿集团(唐山曹妃甸)矿石控股有限公司	贸易商
13	中铁物总国际贸易有限公司	贸易商
14	中信金属股份有限公司	贸易商
15	瑞信国际贸易有限公司	贸易商
16	德天(天津)国际贸易发展有限公司	贸易商
17	东汇投资控股集团有限公司	贸易商
18	东铭矿业(福建)有限公司	贸易商
19	富曼拓新加坡股份有限公司(Fomento)	贸易商
20	福建力聚物流有限公司	贸易商
21	港赋上海贸易有限公司	贸易商
22	嘉能可(北京)商业有限公司	贸易商
23	广东广物国际能源集团有限公司	贸易商
24	海城市恒盛铸业有限公司	贸易商
25	海南矿业大宗供应链事业部	贸易商
26	杭州杭钢对外经济贸易有限公司	贸易商
27	杭州热联集团股份有限公司	贸易商
28	河北德隆国际贸易有限公司	贸易商
29	河北自贸区文丰国际贸易有限公司	贸易商
30	香港國創新材料科技有限公司	贸易商
31	湖南华菱资源贸易有限公司	贸易商
32	内蒙古德晟实业集团	贸易商
33	江苏艾士腾国际贸易有限公司	贸易商
34	江苏象石实业股份有限公司	贸易商
35	冀东发展集团国际贸易有限公司	贸易商

图 4 铁矿石价格指数代表性数据统计

附录 D:Mysteel 铁矿石价格指数代表性数据统计

序号	表单名称	样本采集点	区域内样本总数	占比
1	Mysteel 铁矿石远期现货价格指数	118	143	82.50%
2	Mysteel 铁矿石港口现货价格指数	218	230	94.80%
3	江阴港铁矿石价格行情	64	80	80.00%
4	北仑港铁矿石价格行情	35	45	77.80%
5	太仓港铁矿石价格行情	64	75	85.30%
6	镇江港铁矿石价格行情	50	60	83.30%
7	曹妃甸港铁矿石价格行情	75	80	93.80%
8	京唐港铁矿石价格行情	76	81	93.80%
9	天津港铁矿石价格行情	54	65	83.10%
10	黄骅港铁矿石价格行情	45	55	81.80%
11	鲅鱼圈港铁矿石价格行情	35	43	81.40%
12	大连港铁矿石价格行情	11	13	84.60%
13	日照港铁矿石价格行情	213	224	95.10%
14	青岛港铁矿石价格行情	205	215	95.30%
15	连云港港铁矿石价格行情	61	68	89.70%
16	岚山港铁矿石价格行情	32	36	88.90%
17	岚桥港铁矿石价格行情	25	29	86.20%
18	可门港铁矿石价格行情	14	18	77.80%
19	防城港港铁矿石价格行情	35	40	87.50%
20	湛江港铁矿石价格行情	36	42	85.70%

（2）阐明价格指数的编制背景和目的

为保证价格指数能够反映市场的真实情况，上海钢联在价格指数新增前，有着详尽的市场调研。基于调研的结果，我们会形成价格指数编制的背景和目的，发布于《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》第 5 页（详见图 3）。

图 5 价格指数的编制背景和目的

引 言

本文件阐述了 Mysteel 铁矿石指数（简称为“指数”或“Mysteel 铁矿石指数”）的计算和管理方法。指数旨在反映现货铁矿石市场每天的价格变动，并为铁矿石市场参与者提供重要的定价指标。

Mysteel 编制指数时所遵循的程序和规范，已在 Mysteel 中英文网站上公布，可免费查阅。

Mysteel 铁矿石价格指数的编制背景

铁矿石是国民经济建设不可缺少的助力，是保障国民经济发展的重要基础，铁是世界上发现最早、利用最广、用量也最多的一种金属，其消耗量约占金属总消耗量的 95%。铁矿石主要用于钢铁工业，钢铁制品广泛用于国民经济各部门和人民生活各个方面，是社会生产和公众生活所必需的基本材料，是现代化工业最重要和应用最多的金属材料，钢铁产业是社会发展的重要支柱产业。

近年来，中国大规模的基础建设和消费升级导致铁矿石需求快速上升，使中国成为全球最大的铁矿石消费国。由于中国国内的铁矿石资源禀赋较差，为了满足迅速增长的铁矿石需求，中国铁矿石进口的规模迅速扩大，使中国成为了全球最大的铁矿石进口国。而国际铁矿石进口价格的高位剧烈波动，对中国的整体经济和钢铁产业发展造成了巨大的影响。因此，如何发展铁矿石的稳定、安全供应和清洁、高效利用已成为关系中国可持续发展的重大战略问题之一。

价格指数的编制目的与意义

编制客观、中立的铁矿石价格指数具有重要意义。具体来看如下：

铁矿石价格指数可作为供需双方签订长期合同和现货贸易时价格谈判的重要参考，有助于制定供需双方都能接受的价格，提升谈判效率，建立长期稳定的供应关系；

编制铁矿石价格指数的推出可有效化解由于信息不对称造成的负面影响，以更为定量、透明、直观的方式展现市场即时变化，其对合理引导社会预期、稳定市场价格、促进供需平衡等作用效果明显，从而有效推进铁矿石行业良性竞争、健康发展；

编制铁矿石价格指数有利于实现产业数字化及智慧化转型，并引导市场健康、平稳发展。

（3）清晰界定所反映的对象和范围

Mysteel 所发布的价格指数，对所反映的对象和范围、以及具体价格指数名称在《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》第 7-11 页有着明确的说明（具体内容如下）。

图 6 对象和范围

铁矿石价格指数内容介绍

铁矿石价格指数覆盖的对象和范围

Mysteel 按照区域性名称命名的价格和价格指数，在价格指数编制方案中充分证明，信息采集点覆盖的相应商品或服务市场交易规模在该区域市场中的占比，以及该覆盖面能够准确有效地反映该区域市场价格情况（详见附录 A：价格指数代表性数据统计）。

Mysteel 铁矿石远期现货价格指数

Mysteel 铁矿石远期现货价格指数（SEADEX）反映还未到中国港口，并以美元计价的现货价格，基准港为青岛港，代表了国外矿山，境外贸易商，国内贸易商以及国内外钢厂之间的可交易的价格。该指数的样本包括矿山招标，国内外主要现货交易平台的成交，各类议标，贸易商与钢厂之间的成交

图 7 具体价格指数名称

及询报盘价格等。除价格指数外，每日还公布市场上交易活跃的主流矿山品种价格。指数以美元/干吨的单位为基准。最小的价格浮动单位为 0.05 美元/干吨，最小交易量为 30000 吨。

- 62%澳洲粉矿现货价格指数
- 62%低铝粉矿现货价格指数
- 58%高铝粉矿现货价格指数
- 58%澳洲粉矿现货价格指数
- 65%巴西粉矿现货价格指数
- 63%印度球团现货价格指数
- 63.5%印度粉矿现货价格指数
- 58%印度粉矿现货价格指数
- 65%烧结精粉现货价格指数
- 66%精粉现货价格指数
- 67%造球精粉现货价格指数

Mysteel 铁矿石远期现货溢价指数

Mysteel 铁矿石远期溢价指数主要代表的是矿山、贸易商和钢厂之间的成交、询盘和报盘，主要用于以块矿和球团产品为主的某些溢价产品。块矿溢价指数的单位是美元/干吨度，最小价格波动幅度是 0.0001 美元/干吨度。球团溢价指数的单位是美元/干吨，最小价格波动幅度是 0.05 美元/干吨。两者的基准港均为青岛港。

- Mysteel 铁矿石远期现货溢价指数
  - 62.5%块矿溢价指数
  - 63%纽曼块块矿溢价指数
  - 63%球团溢价指数（基于 62%澳粉指数）
  - 63%印球溢价指数（基于 62%澳粉指数）
  - 65%球团溢价指数（基于 62%澳粉指数）
  - 65%球团溢价指数（基于 65%巴西粉矿指数）

Mysteel 铁矿石远期现货品牌价格

Mysteel 铁矿石远期现货单品种品牌价格指数代表用于矿山、贸易商和钢厂之间的成交、询盘和报盘的不同品种的固定价格。单品种指数的单位是美元/干吨（NBL 块矿溢价为美元/千吨度），最小价格波动幅度是 0.05 美元/干吨（NBL 块矿溢价为 0.0001 美元/千吨度），基准港为青岛港。

- Mysteel 铁矿石远期品牌价格
  - PBF 远期现货价格
  - NHGF 远期现货价格
  - MACF 远期现货价格
  - JMBF 远期现货价格
  - YDF 远期现货价格
  - SSF 远期现货价格
  - FBF 远期现货价格
  - Robe Valley Fines 远期现货价格
  - IOCJ 远期现货价格
  - BRBF 远期现货价格
  - PBL 远期现货价格
  - NBL 远期现货价格

Mysteel 铁矿石远期现货品种浮动溢价

Mysteel 铁矿石远期现货品种浮动溢价代表用于矿山、贸易商和钢厂之间的成交、询盘和报盘的不同品种的浮动溢价。单品种浮动溢价的单位是美元每干吨，最小价格波动幅度是 0.05 美元/干吨，基准港为青岛港。

基于 Mysteel62%指数的远期铁矿石浮动溢价

- PBF 远期现货浮动价格（PB 粉）
- NHGF 远期现货浮动价格（纽曼粉）
- MACF 远期现货浮动价格（麦克粉）
- JMBF 远期现货浮动价格 （金布巴粉）
- YDF 远期现货浮动价格（扬迪粉）

- IOC6 远期现货浮动价格（IOC6）

基于 Mysteel62%低铝指数的远期铁矿石浮动溢价

- BRBF 远期现货浮动价格（巴西混合粉）

基于 Mysteel65%指数的远期铁矿石浮动溢价

- IOCJ 远期现货浮动价格（卡拉加斯粉）

Mysteel 铁矿石港口现货价格指数

Mysteel 铁矿石港口现货价格指数（PORTDEX）代表了以人民币计价，包括矿山、贸易商和钢厂之间在中国港口贸易的进口铁矿石交易价格。计算这些指数时使用的信息来源包括矿山成交、主要铁矿石交易平台的交易、私人谈判以及贸易商和钢铁厂之间的交易、询盘和报盘。

Mysteel 港口现货品牌价格

Mysteel 港口现货品牌价格（Brand Price）特指各矿山具体各品种在中国港口的交易价格。目前 Mysteel 港口现货品牌价格指数涵盖了国内 18 个港口：天津港口、京唐港口、曹妃甸港口、黄骅港口、大连港口、鲅鱼圈港口、青岛港口、日照港口、岚山港口、岚桥港口、连云港港口、太仓港口、江阴港口、镇江港口、北仑港口、防城港港口、湛江港口和可门港港口。最小价格变动单位为 1 元/湿吨， 最小交易量为 3000 吨（参照附录 A：港口现货品牌价格典型值）。

- Mysteel 铁矿石港口现货品牌价格指数
  - PBF 港口现货价格
  - NHGF 港口现货价格
  - JMBF 港口现货价格
  - MACF 港口现货价格
  - IOCJ 港口现货价格
  - BRBF 港口现货价格
  - SSF 港口现货价格
  - FBF 港口现货价格
  - YDF 港口现货价格
  - 33 个其他非主流产品港口现货价格

Mysteel 铁矿石港口现货综合价格指数

Mysteel 铁矿石港口现货价格综合指数代表着港口上基于人民币价格的指数。它们代表着国内和国际贸易商、钢厂的可交易价格；样本包括钢厂招标、现货交易平台成交、贸易商与钢厂之间的成交、市场中的可成交价格及询报盘价格等。

Mysteel 发布青岛港、日照港、连云港港、曹妃甸港、京唐港、天津港、江阴港、防城港港 8 个港口的铁矿石港口现货价格指数；上述 8 个港口均发布 62%澳粉港口现货价格指数、65%巴粉港口现货价格指数和 58%澳粉港口现货价格指数，最小变动单位为 1 元/湿吨，车板含税价，最小交易量为 3000 吨。

Mysteel 62.5%港口现货块矿溢价和 62.5%港口现货块矿溢价美元折算价则是基于青岛港，最小变动单位分别为 0.0001 元/千吨度和 0.0001 美元/千吨度

61%港口现货价格指数及其美元折算价与 62%MNPJ 港口现货价格指数及其美元折算价同样是基于青岛港，同时以价差的形式来公布其他港口参考价，包括日照港、京唐港、曹妃甸港、天津港、连云港和岚桥港；61%指数与 62%MNPJ 指数为干吨含税车板价（FOT），单位为元/干吨，此两者的美元折算价为干吨不含税到港价（CFR），单位为美元/干吨。

- 62%澳粉港口现货价格指数
- 65%巴粉港口现货价格指数
- 58%澳粉港口现货价格指数
- 62.5%港口现货块矿溢价
- 62.5%港口现货块矿溢价美元折算价
- 61%港口现货价格指数
- 61%港口现货价格指数美元折算价
- 62%MNPJ 港口现货价格指数
- 62%MNPJ 港口现货价格指数美元折算价

2.有明确的、合理的价格信息采集点和代表规格品

上海钢联有明确合理的价格信息采集点，覆盖了相关产业上中下游的生产企业、贸易企业及终端用户群体。同时，上海钢联有着严格的客户管理制度，各品种团队会根据相应的区域和市场差异，对价格采集点进行分类管理。例如按区域、币种（即以美元结算为主的远期现货和以人民币结算为主的港口现货）等进行标准化工作表管理，并有着严格的考核制度。上海钢联在编制铁矿石价格过程中收集了大量的产业链上中下游的采

销合同，在详细研究的基础上，确定了一系列符合市场交易现状的代表性规格，以保证符合市场参与者的交易结算需求。

3.明确计算价格指数使用的数据形式和优先级

上海钢联明确了计算价格的数据形式，严格把控提交收集过程，只考虑遵循标准合同条款的成交、报盘和询盘以及可成交价格。上海钢联不仅收集相关的价格信息，还收集其他重要的额外信息，包括支付、物流和最终产品交付。《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》中明确了价格计算的优先级，若有足够的成交样本数据，最终值是样本标准化后的平均值。如果某一特定价格的成交提交数量不足，也会使用可成交、询盘和报盘。同时详细规定了样本层级，在没有收到足够的成交时，保留使用主观判断的权利，包括参考其他市场信息，如供需基本面和影响铁矿石价格的其他因素等。

4.明确数据权重和价格指数计算公式

上海钢联针对市场上可能发生的各种情况制定了不同的情形处理办法，明确各种情形下使用的数据形式、数据权重、优先级和计算公式。上海钢联铁矿石价格指数主要是通过两级权重设计的方式实现的。第一步，分指数（成交、可成交、询盘及报盘）权重的计算，按照数量加权平均；第二步，分指数结果根据样本类型所赋予的权重得出指数最终值，在《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》第 15-17 页有具体的细化描述和公开披露（见图 3）。

图 8 价格指数计算流程说明

价格指数计算

SEADEX

样本筛选

Mysteel 数据处理团队会对收集的所有提交进行初步筛选。除了检查每项提交的基本信息，如数量、交货日期、交货港和价格，Mysteel 还会与至少一方确认报告成交的细节，以确保样本的真实性。

根据样本类型，通过初步筛选分为四类：成交、可成交价格、询盘和报盘。

样本标准化

Mysteel 根据品牌、计价类型、化学规格、装船期、付款方式和不同港口运费差价等依据 Mysteel 指数标准值对四类样本进行标准化。

样本中所包含的其他化学指标（如二氧化硅、氧化铝、硫、和水分）超出 Mysteel 指数标准范围，将被排除在标准化流程之外。

Mysteel 已经设定了不同品牌铁矿石的化学规格标准值，并根据矿山公布的信息或合同信息，并结合市场信息。依照市场变化的需要，至少每半年会对这些规格标准值进行更新。

在远期市场(如青妃甸、天津、北仑、湛江、防城等)不同交货港的成交、报盘和询盘，都将被转换成 Mysteel 指数基准港口(青岛)，价格根据当时该港口和青岛之间的运输费差价做出调整。

对于远期货物，样本不包括装船期或交货期时间太短或太长的货物。交货期应在指数发布日期后二至八周内。

将一类中的某项提交的标准化价格与其他已经标准化的类别的提交相比，如果有明显异常，Mysteel 将再次确认样本的细节。如果提交中的数据不完整、不透明，或者成交双方有分歧，以及标准化价格明显偏离市场水平（即不在数据两个标准差范围之内），该样本将被移除。

一旦确认所有样本有效，样本将用于指数计算。

粉矿指数计算

Mysteel 旨在为市场提供一个准确追踪每日价格变化的公允价格。因此，若有足够的提交数据，每个指数的最终值都是标准化成交样本的成交量加权平均值。Mysteel 团队将根据 Mysteel 数据层级标准优先采用层级较高的数据。

如果某一特定指数的成交样本提交数量不足，Mysteel 也会使用可成交价格、询盘和报盘数据,此情况下，成交、可成交、询盘和报盘四种类型的价格都会基于数量加权计算。

球团指数计算

Mystee球团价格指数是一个统称，其中包括63%乌克兰球团价格、65%乌克兰球团价格以及63%印度球团远期现货价格指数。具体来看，63%印度球团远期现货价格指数估价使用的是流通性偏好的印度球团；63%与 65%乌克兰球团价格则分别使用相应品位的乌克兰球团与俄罗斯球团。

参照市场上球团的成交价格、可成交价格、报盘价格和询盘价格，通过球团的铁硅铝标准化计算得出，其中使用固定球团溢价的样本参照当日指数计算使用的对应月掉期+固定球团溢价转换为对应品牌固定价格，不考虑船期。

通过成交、询报盘数量加权平均，再赋予成交、询盘和报盘固定权重，经过二次加权平均计算得出。

由于目前的现货成交情况，金属特性并没有特别标注出来。市场参与者对各个品牌的定价是混着他们的化学，物理和金属特性，主要是基于他们之前对这些品种的理解来定价。

块矿溢价指数计算

该估价是块矿相对于粉矿价格的溢价。价格信息直接从市场获取，或是块矿和粉矿之间的差价转换成以干吨度为单位的溢价。

由于目前的现货成交情况，金属特性并没有特别标注出来。市场参与者对各个品牌的定价是混着他们的化学，物理和金属特性，主要是基于他们之前对这些品种的理解来定价。

球团溢价指数计算

该估价是高炉球团相对于粉矿价格的溢价。价格信息直接从市场获取，或是球团和粉矿之间的差价转换成的溢价。

远期市场品牌价格计算

Mysteel 品牌价格是反映各品种的一个可成交价格。样本是基于 Mysteel 数据以及提交者层级而得出。对于远期市场品牌价格，样本主要是根据铁和时间来确认，主要采用对应品种的单一种类样本。标准化过程和 62%指数计算方法一致。

PORTDEX

样本筛选

Mysteel 数据处理团队会对收集的所有提交进行初步筛选。除了检查每项提交的基本信息，如数量、交货港、化学指标和价格，Mysteel 还会与至少一方确认报告成交的细节，以确保样本的真实性。

根据样本类型，通过初步筛选分为四类：成交、可成交、询盘和报盘。

样本标准化

Mysteel 根据相应的指数标准值规格，依据 Mysteel 化学指标类别对样本的铁含量以及含水量进行标准化处理。

Mysteel 设定了不同品牌铁矿石的化学规格标准值。根据矿山公布的信息或合同信息，结合市场调研信息，并依照市场变化的需要季度对这些规格标准值进行更新。当矿山调整品种典型值时，该品种标准值将在矿山正式公告后，Mysteel 将结合市场具体情况并在适合的时间段内进行更新。

样本中所包含的其他化学指标（如二氧化硅、氧化铝、硫、和水分）超出 Mysteel 指数标准范围，将被排除在标准化流程之外。

将一类中的某项提交的标准化价格与其他已经标准化的类别的提交相比，如果有明显异常，Mysteel 将再次确认样本的细节。如果提交中的数据不完整、不透明，或者成交双方有分歧，该样本将被移除。

一旦确认所有样本有效，样本将用于指数计算。

加权计算

Mysteel 港口现货品牌价格是反映各品种的一个可成交价格。样本是基于 Mysteel 数据以及提交者层级，也反应了每天市场上的报盘、报盘和成交价格。对于港口市场品牌价格，样本主要是根据铁和水分来确认，具体的标准化过程和 62%指数计算方法一致。

图 9 样本权重设置

Sample ID	日期 Date	品种 Brand	港口 Port	等级 Grade	价格 Price	量 Quantity	价格类型 Sample Type	水 Moisture	干吨价	铁量 Fe (56%-60%)	铁量 Fe (60%-63%)	铁量 Fe (63%-65%)	Fe VIU	硅量 Si (<4%)	硅量 Si (4%-4.5%)	硅量 Si (4.5%-6%)	硅量 Si (>6%)	Si VIU	铝量 Al (1%-1.55%)	铝量 Al (1.55%-2%)	铝量 Al (2%-2.5%)	铝量 Al (>2.5%)	Al VIU	硫量 S	S VIU	磷量 P	P VIU	品牌系数	标准化价格 Normalized Price	标准差检验 Validation Stats	样本数据剔除 Brand Exclusion	权重 Weight	权重% Weight	分指数 Sub index
1	2022/3/31	PB粉	青岛港	61.50%	995	10000	成交	6.1%	1067.431894	0.00%	0.50%	0.00%	125.00	0.20%	0.1%	0.0%	0.2%	-34.1	0.00%	0.00%	0.25%	0.00%	-12	0.00%	0	0.00%	0	0	1022.33	1.00	1	60000	6.4%	46.8543524
2	2022/3/31	PB粉	青岛港	61.50%	1005	10000	报盘	6.1%	1066.160656	0.00%	0.50%	0.00%	125.00	0.20%	0.1%	0.0%	0.2%	-34.1	0.00%	0.00%	0.25%	0.00%	-12	0.00%	0	0.00%	0	0	1015.26	1.00	1	20000	2.1%	7.8854844857
3	2022/3/31	PB粉	青岛港	61.50%	1000	10000	报盘	6.1%	1062.896173	0.00%	0.50%	0.00%	125.00	0.20%	0.1%	0.0%	0.2%	-34.1	0.00%	0.00%	0.25%	0.00%	-12	0.00%	0	0.00%	0	0	1017.60	1.00	1	10000	0.9%	1.8497221037
4	2022/3/31	PB粉	青岛港	61.50%	990	10000	可成交	6.1%	1061.967213	0.00%	0.50%	0.00%	125.00	0.20%	0.1%	0.0%	0.9%	-34.1	0.00%	0.00%	0.25%	0.00%	-12	0.00%	0	0.00%	0	0	1016.67	1.00	1	200000	1.5%	15.3249692528
5	2022/3/31	PB粉	青岛港	61.50%	990	10000	可成交	6.1%	1061.967213	0.00%	0.50%	0.00%	125.00	0.20%	0.1%	0.0%	0.9%	-34.1	0.00%	0.00%	0.25%	0.00%	-12	0.00%	0	0.00%	0	0	1016.67	1.00	1	200000	1.5%	15.3249692528
6	2022/3/31	PB粉	青岛港	61.50%	980	10000	询盘	6.1%	1071.038251	0.00%	0.50%	0.00%	125.00	0.20%	0.1%	0.0%	0.9%	-34.1	0.00%	0.00%	0.25%	0.00%	-12	0.00%	0	0.00%	0	0	1005.94	1.00	1	10000	0.9%	7.4789679849
7	2022/3/31	PB粉	青岛港	61.50%	980	10000	报盘	6.1%	1071.038251	0.00%	0.50%	0.00%	125.00	0.20%	0.1%	0.0%	0.9%	-34.1	0.00%	0.00%	0.25%	0.00%	-12	0.00%	0	0.00%	0	0	1005.94	1.00	1	10000	0.9%	7.4789679849
8	2022/3/31	金布巴西60.5%	青岛港	60.50%	860	10000	报盘	7.0%	934.7311828	0.00%	-0.50%	0.00%	150.00	0.00%	0.4%	0.0%	0.3%	-22	0.00%	0.00%	0.00%	-0.40%	-20	0.00%	0	-0.02%	50	0	997.73	1.00	1	10000	0.9%	7.6145856571
9	2022/3/31	金布巴西60.5%	青岛港	60.50%	865	10000	可成交	7.0%	930.1075269	0.00%	-0.50%	0.00%	150.00	0.00%	0.4%	0.0%	0.3%	-22	0.00%	0.00%	0.00%	-0.40%	-20	0.00%	0	-0.02%	50	0	1003.11	1.00	1	200000	1.5%	15.3149453
10	2022/3/31	金布巴西60.5%	青岛港	60.50%	865	10000	可成交	7.0%	930.1075269	0.00%	-0.50%	0.00%	150.00	0.00%	0.4%	0.0%	0.3%	-22	0.00%	0.00%	0.00%	-0.40%	-20	0.00%	0	-0.02%	50	0	1003.11	1.00	1	200000	1.5%	15.3149453
11	2022/3/31	金布巴西60.5%	青岛港	60.00%	850	10000	询盘	7.0%	913.9784946	-0.00%	-1.00%	0.00%	300.00	-0.00%	0.4%	0.0%	0.5%	-22	0.00%	0.00%	0.00%	-0.40%	-20	0.00%	0	-0.02%	50	0	1005.98	1.00	1	10000	0.9%	7.6787253553

针对当天收集到的样本类型不同，设计了样本类型情形表（见下图）

图 10 样本类型情形表

情形	成交分指数	可成交分指数	询盘分指数	报盘分指数	相关市场分指数	计算公式
• 采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 搜集到可靠的可成交价格 • 询盘样本和报盘样本各自至少有一条	60%	20%	10%	10%	–	MIODEX=成交*60%+可成交*20%+询盘*10%+报盘*10%
• 采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 没有搜集到可靠的可成交价格 • 询盘样本和报盘样本各自至少有一条	60%	–	20%	20%	–	MIODEX=成交*60%+询盘*20%+报盘*20%
• 采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 搜集到可靠的可成交价格 • 询盘样本及报盘样本不足	60%	40%	–	–	–	MIODEX=成交*60%+可成交*40%
• 没有采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 搜集到可靠的可成交价格 • 询盘样本和报盘样本各自至少有一条	–	60%	20%	20%	–	MIODEX=可成交*60%+询盘*20%+报盘*20%

情形	成交分指数	可成交分指数	询盘分指数	报盘分指数	相关市场分指数	计算公式
• 采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 搜集到可靠的可成交价格 • 询盘样本及报盘样本不足	100%	–	–	–	–	MIODEX=成交*100%
• 没有采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 没有搜集到可靠的可成交价格 • 询盘样本或报盘样本各自至少有一条	–	–	50%	50%	–	MIODEX=询盘*50%+报盘*50%
发生灾难/恐怖袭击等不可抗拒事件时 • 没有采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 未搜集到可靠的可成交价格 • 询盘样本或报盘样本不足两条 • 没有可参考的相关市场信息	–	–	–	–	100%	MIODEX=相关市场分指数（流动性最好的，密切相关的品种，衍生品市场，前一天相关铁矿石市场）
• 没有采集到符合Mysteel样本要求的成交信息 • 搜集到可靠的可成交价格 • 询盘和报盘样本不足	–	100%	–	–	–	MIODEX=可成交*100%

图 11 远期现货价格指数计算举例

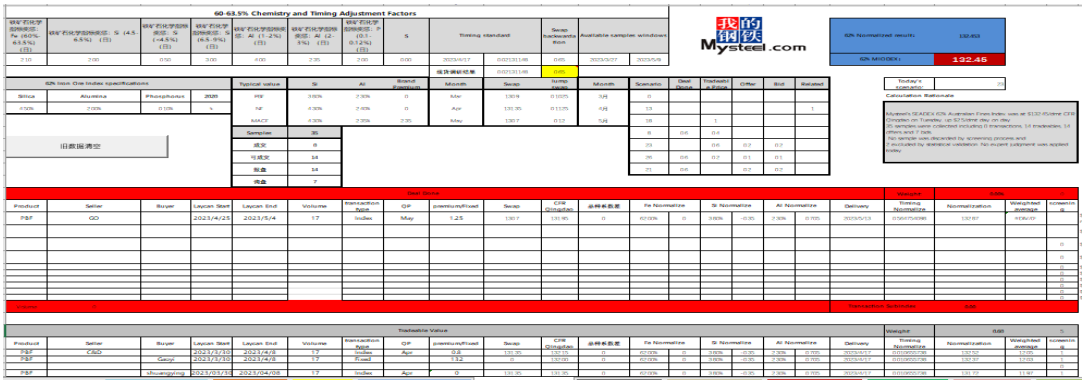
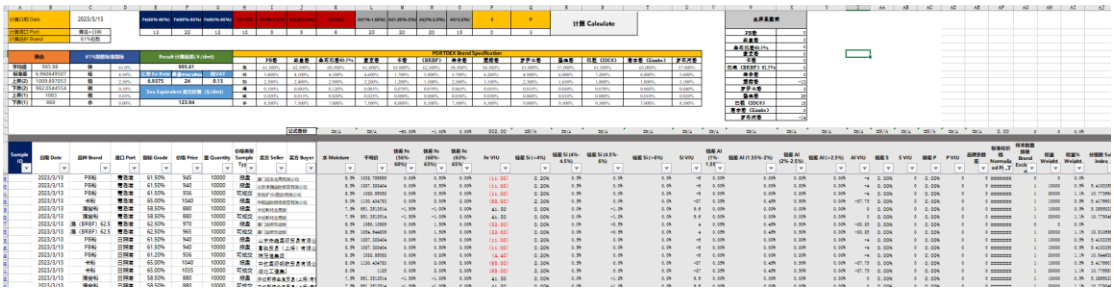


图 12 港口现货价格指数计算举例



5. 明确价格指数发布方式和频率

上海钢联铁矿石价格通过铁矿石频道页面、 APP 等途径发布， 除部分重要市场价格会在每个工作日早上和下午两个相应固定的时间发布之外，其他市场价格在每个规定的工作日内仅发布一次。

6. 相对价格指数有明确的基期基点

上海钢联铁矿石价格均为绝对价格，并未包含政策中所提到的相对价格，因此不存在基期基点的问题。

7. 制定保证价格信息真实性的审核、监督、处罚等约束措施和对价格信息提供方的鼓励措施

上海钢联制定了一系列保证价格真实性的审核、监督、处罚等约束措施。铁矿石价格指数团队会核实每项成交、可成交、询盘和报盘提交的细节，包括产品类型、化学规

格、产地、数量、价格、交货日期和交货港，以确保每份价格样本的真实性。价格指数团队成员有成熟的经验，具备识别数据真实性的能力。同时内部制定了详尽的标准化工作表和采集执行的奖罚制度，针对数据采集好坏进行奖罚。为保证价格信息真实性，上海钢联严格控制来自外部的价格信息，制定了《提交者审核过程政策》、《提交者行为准则》与《上海钢联数据提交协议》。

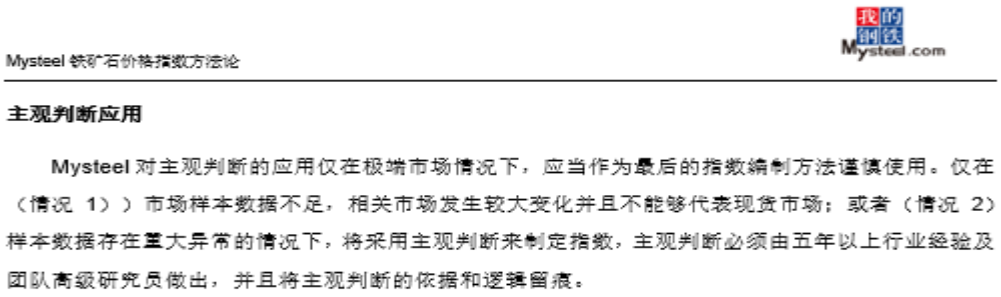
8.严格限定使用主观判断的合理条件及优先级，且在实际编制过程中严格审慎使用主观判断

针对价格编制过程中使用主观判断的情况，上海钢联严格限定了合理条件及优先级。使用主观判断的条件严格限定为仅市场样本不足，相关市场发生较大变化并且不能代表现货市场的情况。对使用主观判断的合理条件及优先级在价格指数方法论中作了详尽的描述。具体详见以下两点：

（1）严格限定使用主观判断的合理条件及优先级

上海钢联在价格指数编制过程中，针对主观判断的使用，严格限定了合理条件及优先级来保证价格指数的独立性及公正性。在《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》第 19 页有着明确的要求（详见图 12）。

图 13 主观判断


Mysteel 铁矿石价格指数方法论

主观判断应用

Mysteel 对主观判断的应用仅在极端市场情况下，应当作为最后的指数编制方法谨慎使用。仅在（情况 1））市场样本数据不足，相关市场发生较大变化并且不能够代表现货市场；或者（情况 2）样本数据存在重大异常的情况下，将采用主观判断来制定指数，主观判断必须由五年以上行业经验及团队高级研究员做出，并且将主观判断的依据和逻辑留痕。

（2）在实际编制过程中严格审慎使用主观判断

上海钢联在价格指数编制过程中，严格审慎使用主观判断，有着详尽的流程管理和内部控制。

在进行主观判断的实际过程中，每次主观判断的依据将上传至网盘上进行留痕，并通过邮件发送至指数负责人（经理） 进行审核，确认后才被允许发布，另外主观判断的过程同步在价格指数显著位置进行披露，并在每季度的指数管理委员会的会议上进行汇报。

截止目前，上海钢联铁矿石价格指数行情编制过程中没有使用主观判断的情况。

图 14 价格指数主观判断披露

2023年8月1日Mysteel铁矿石远期现货价格指数

2023-08-01 18:58:55 | 来源：我的钢铁 | 价格中心>>

分享到： 手机看价格 资讯监督 打印 复制链接

2023年8月1日，Mysteel铁矿石远期现货指数信息采集点3 33个，成交量24万吨。样本数量百分比（非权重）：成交数据占比2%，可成交数据占比41%，询报盘数据 断。其中Mysteel62%澳粉指数样本标准化后的最高值为110.07，最低值为107.14，平均值为108.61，相 lysteel铁矿石价格指数方法论要求。

扫描二维码下载我的钢铁手机版APP

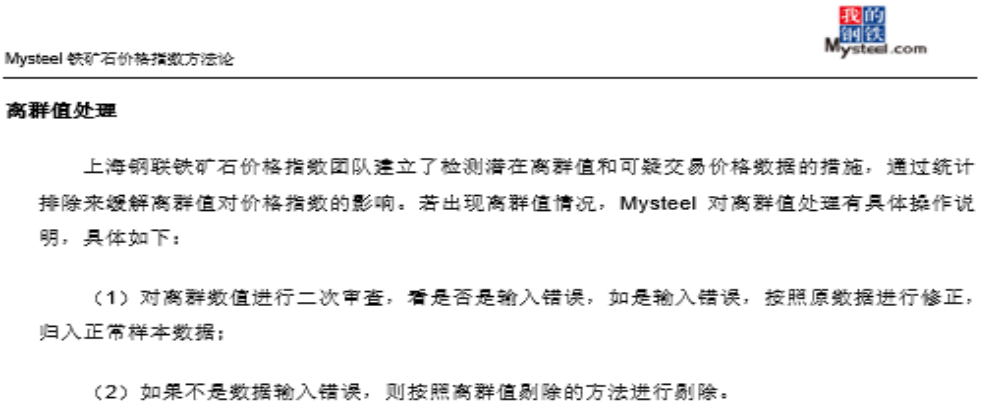
名称 请筛选	品位 请筛选	请筛选	价格	涨跌	备注
当前筛选					
澳洲粉矿	62.00%	澳大利亚	108.8	-1.55	
低铝粉矿	62.00%	不限	110.65	-1.65	
澳洲粉矿	58.00%	澳大利亚	97.4	-1.55	
巴西粉矿	65.00%	巴西	121.65	-1.8	
65%精粉	65%	不限	116.9	-1.8	
66%精粉	66%	不限	121.55	-1.8	
印度球团	63.00%	印度(*)	116.1	-1.55	
块矿溢价	62.50%	澳大利亚	0.1435	+0.0035	美元/干吨度
纽曼块溢价	63.00%	澳大利亚	0.1435	+0.0035	美元/干吨度
乌克兰/俄罗斯球团溢价	65.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	9.8	+0.25	基于65%指数
乌克兰/俄罗斯球团溢价	65.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	17.4	-	基于62%指数
印度球团溢价	63.00%	印度(*)	5.4	-	基于62%指数
乌克兰/俄罗斯球团溢价	63.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	6.1	-	基于62%指数
PB粉	61.50%	澳大利亚	2.75	+0.65	浮动溢价
纽曼粉	62.30%	澳大利亚	1.3	+0.4	浮动溢价
麦克粉	60.80%	澳大利亚	0.8	+1.35	浮动溢价

9. 有处理离群值或可疑交易的合理标准，对少数价格信息采集点数据占较大比例的情形有合理处理措施

上海钢联铁矿石价格指数团队建立了检测潜在离群值和可疑交易价格数据的措施，通过统计排除来缓解离群值对价格指数的影响。若出现离群值情况，Mysteel 对离群值处理有具体操作说明，上海钢联铁矿石价格指数针对离群值的处理标准是 当

样本数据标准化结果在均值正负两个(或一个)标准差范围内(平均值±2*标准差)，及为最终纳入指数计算的样本。那些在 95%置信区间外的样本，或者说两个标准差外的样本将被排除。在《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》第 14 页有着明确的要求

图 15 离群值处理


Mysteel 铁矿石价格指数方法论

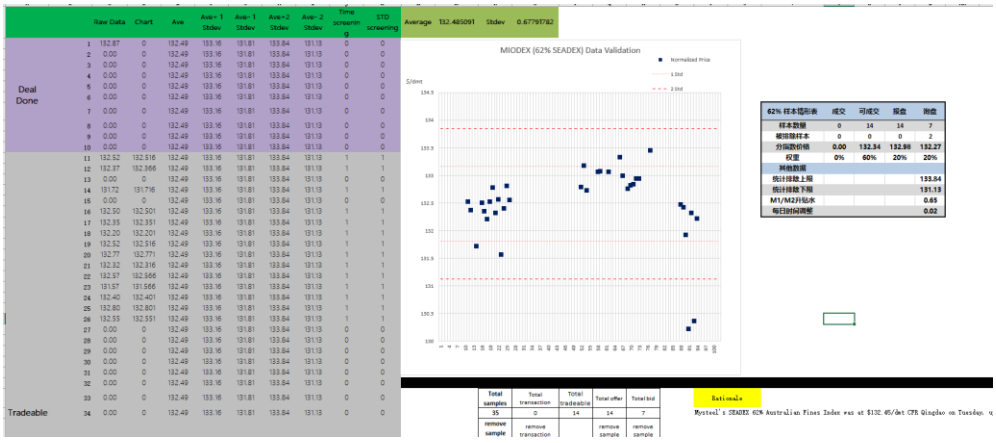
离群值处理

上海钢联铁矿石价格指数团队建立了检测潜在离群值和可疑交易价格数据的措施，通过统计排除来缓解离群值对价格指数的影响。若出现离群值情况，Mysteel 对离群值处理有具体操作说明，具体如下：

（1）对离群数值进行二次审查，看是否是输入错误，如是输入错误，按照原数据进行修正，归入正常样本数据；

（2）如果不是数据输入错误，则按照离群值剔除的方法进行剔除。

图 16 价格指数计算离群值处理举例



（2）针对少数价格信息采集点数据占较大比例的情形的处理措施

上海钢联铁矿石价格团队建立了对少数价格信息采集点数据占较大比例情形的处理措施，在《Mysteel 铁矿石价格指数内部手册》第 17 页有着明确的要求(详见图 17)。

图 17 对少数价格信息采集点数据占较大比例情形处理

针对少数价格信息采集点数据占较大比例的情形的处理措施

Mysteel 铁矿石价格团队建立了对少数价格信息采集点数据占较大比例情形的处理措施具体如下：

1) 对于计划新增价格或价格指数的前期，通过市场调研发现此类情形但无法通过增加样本企业总数以缓释单个样本占比失衡问题，说明此市场缺乏流动性，Mysteel 不会对此类市场价格进行发布；

2) 对于现有运行的价格指数，随着市场的变化出现此类情形但无法通过增加样本企业总数以缓释单个样本占比失衡问题，Mysteel 将终止此类价格的发布，但在终止发布前 6 个月向市场告知。

截止 2023 年底，上海钢联铁矿石价格没有出现少数价格信息采集点数据占较大比例的情况。

三、价格指数发布透明性和完整性

1.在指数发布渠道显著位置公开发布价格指数行为主体的基本情况及变动情况。接受委托开展价格指数编制、发布、运行维护的，还应包括委托方基本情况及变动情况

上海钢联在所有铁矿石价格行情页面的下方均有行为主体的基本情况及变动情况的介绍，链接为： https://about.mysteel.com/about/index.html

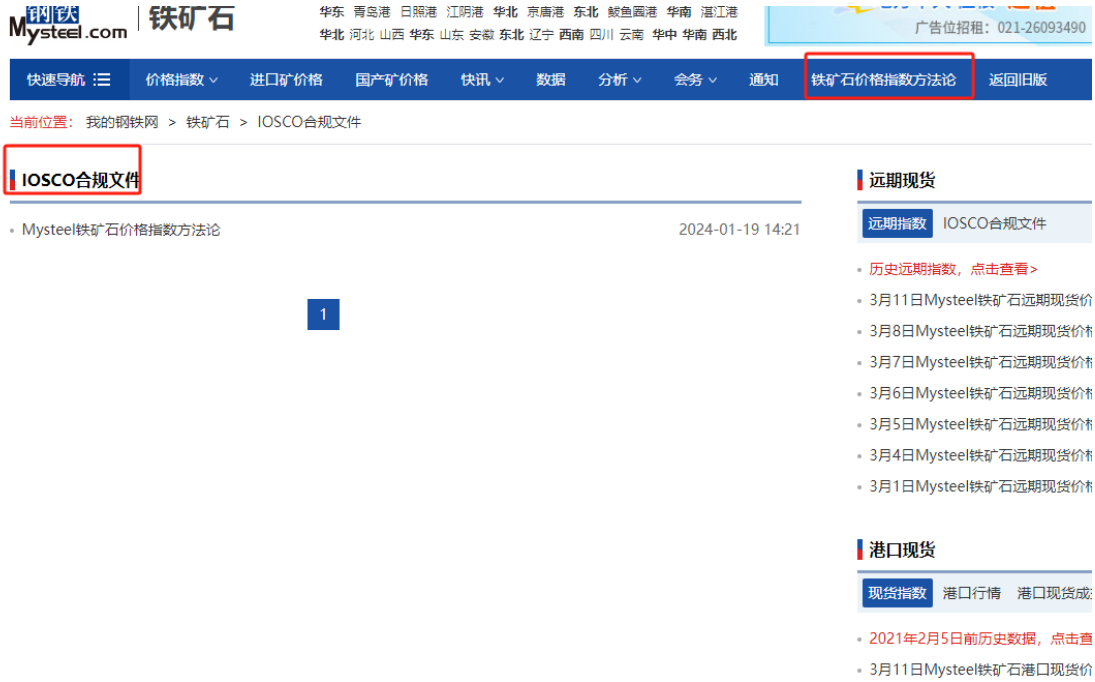
上海钢联铁矿石价格的编制过程中不存在接受委托开展价格编制、发布、运行维护的情况。

2.发布渠道显著位置公开发布价格指数编制方案及调整情况

上海钢联在价格指数对外发布平台的显著位置公开发布价格指数编制方案及调整情况。

上海钢联在铁矿石频道(https://tks.mysteel.com/)页面导航栏“铁矿石价格指数方法论”中建立了“IOSCO 合规文件”的查阅通道，并在其中公开披露了价格指数编制方案及调整情况。

图 18 铁矿石频道页面披露截图



3. 在指数发布渠道显著位置公开发布价格指数最新值的简要计算基础和过程，包括价格信息采集点的数量、样本量、成交量、价格的范围和平均值，在计算价格指数时使用的每种数据形式的百分比，以及主观判断的使用情况

自 2021 年 6 月 12 日《重要商品和服务价格指数行为管理办法（试行）》发布后，上海钢联积极学习和自查，从 2023 年 2 月 18 日开始在网站铁矿石价格表单同一位置披露了价格指数最新值的简要计算基础和过程。

披露模板：当天日期，Mysteel 铁矿石远期现货指数信息采集点共 XXX 个，样本总数 XXX 个，成交量 XXX 万吨。样本数量百分比（非权重）：成交数据占比 XXX%，可成交数据占比 XXX%，询报盘数据占比 XXX%，有无主观判断。其中 XX 指数样本标准化后的最高值为 XXX，最低值为 XXX，平均值为 XXX，相关样本范围均符合 Mysteel 铁矿石价格指数方法论要求。

图 19 价格指数最新值的简要计算基础和过程披露

2023年8月1日Mysteel铁矿石远期现货价格指数

2023-08-01 18:58:55 | 来源：我的钢铁 | 价格中心>>

分享到： 手机看价格 资讯监督 打印 复制链接

2023年8月1日，Mysteel铁矿石远期现货指数信息采集点 33个，成交量24万吨。样本数量百分比（非权重）：成交数据占比2%，可成交数据占比41%，询报盘数据 断。其中Mysteel62%澳粉指数样本标准化后的最高值为110.07，最低值为107.14，平均值为108.61，相 lysteel铁矿石价格指数方法论要求。

扫描二维码下载我的钢铁手机版APP

名称 请筛选	品位 请筛选	请筛选	价格	涨跌	备注
当前筛选					
澳洲粉矿	62.00%	澳大利亚	108.8	-1.55	
低铝粉矿	62.00%	不限	110.65	-1.65	
澳洲粉矿	58.00%	澳大利亚	97.4	-1.55	
巴西粉矿	65.00%	巴西	121.65	-1.8	
65%精粉	65%	不限	116.9	-1.8	
66%精粉	66%	不限	121.55	-1.8	
印度球团	63.00%	印度(*)	116.1	-1.55	
块矿溢价	62.50%	澳大利亚	0.1435	+0.0035	美元/干吨度
纽曼块溢价	63.00%	澳大利亚	0.1435	+0.0035	美元/干吨度
乌克兰/俄罗斯球团溢价	65.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	9.8	+0.25	基于65%指数
乌克兰/俄罗斯球团溢价	65.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	17.4	-	基于62%指数
印度球团溢价	63.00%	印度(*)	5.4	-	基于62%指数
乌克兰/俄罗斯球团溢价	63.00%	乌克兰/俄罗斯(*)	6.1	-	基于62%指数
PB粉	61.50%	澳大利亚	2.75	+0.65	浮动溢价
纽曼粉	62.30%	澳大利亚	1.3	+0.4	浮动溢价
麦克粉	60.80%	澳大利亚	0.8	+1.35	浮动溢价

4. 指数发布渠道显著位置公开发布利益相关方的投诉受理渠道和处理机制

上海钢联制定了《投诉政策》和《投诉处理过程》，详细说明了接收和调查有关上海钢联价格的投诉程序，并设立了电话、邮件与信件等三个投诉接收渠道，以保证投诉渠道畅通。

5. 利益相关方的投诉，及时反馈调查和处理结果，并以适当形式发布

截止 2023 年底，上海钢联铁矿石价格指数团队没有收集到来自任何利益相关方有关价格的投诉。如果收到投诉，讲严格按照《投诉政策》和《投诉处理过程》的要求进行处理，并将处理结果进行登记入册。

6. 指数发布渠道显著位置公开发布价格指数年度自我评估结果

上海钢联在《重要商品和服务价格指数行为管理办法（试行）》发布后积极学习并对标，建立了自我评估报告的模板，并于每年一季度在上海钢联价格指数发布渠道显著位置对外公开发布价格指数年度自我评估结果。

7.对外发布前试运行不少于6个月（该项目仅适用于《办法》生效后开始编制发布的价格指数，且仅适用于相关价格指数首次评估审核）

在2023年，上海钢联有编制发布新增价格指数的情况

港口现货：2023年3月15日新增天津港纽曼筛后块价格行情；2023年4月3日新增港口现货可门港铁矿石价格行情内容（包括PB粉和巴混（BRBR）两个品种）；2023年4月20日新增青岛港、连云港港、江阴港62.5%卡拉拉精粉价格行情；2023年6月20日新增江阴港托克粉、高硅巴粗，防城港港、湛江港巴粗（IOC6），青岛港、日照港高硅巴粗，曹妃甸港印粉57%（共5条）；2023年8月1日新增湛江港SP10粉价格行情；2023年8月31日新增黄骅港卡粉价格行情；2023年11月23日新增青岛港、连云港港SP10粉价格行情

远期现货：2023年8月1日新增远期现货67%造球精粉指数价格；2023年10月9日新增远期现货58%高铝粉矿指数。

国产矿：2023年6月26日新增攀枝花国产铁精粉价格行情；2023年12月21日新增辽宁65%铁精粉价格指数；2023年12月22日新增安徽、河钢、湖南、湖北、福建、江西、四川、云南、贵州钢厂铁精粉采购价格（共31条）

并均按照《办法》要求在发布前采取了超过6个月的内部试运行。

四、价格指数运行维护

1.建立完善的价格信息提交制度，明确采集价格信息的人员、提交标准、提交时间和提交方式

上海钢联有完善的价格信息提交制度，制定了《提交者审核过程政策》、《提交者行为准则》与《数据提交协议》，明确提交价格信息的人员、提交标准、提交时间和提交方式等。

上海钢联价格信息采集有详尽的标准化工作表，表格规定了采集人、采集企业等具

体要求。同时，在《Mysteel 铁矿石价格指数方法论》及样本数据表内规定了包括产品类型、化学、规格、产地、数量、价格、交货日期和交货港在内的详细指标。

2.价格信息采集方式能够满足追溯查询需要

上海钢联有一套详尽的采集存储的管控流程，以求能够满足追溯查询的需要。具体来讲，价格采集人员按照标准化工作表的要求进行价格数据的采集、反馈及录入，并在规定时间内上传样本数据。

上海钢联价格信息提交方式包括 OA 呼叫系统、企业微信、微信、邮件等，都可以满足价格信息追溯查询的需要。

3.采集的所有价格信息进行核实，并有核实记录

上海钢联铁矿石价格指数团队会核实每项成交、询盘和报盘提交的细节以及相关可成交价格，包括产品类型、化学规格、产地、数量、价格、交货日期和交货港，以确保每份价格指数样本的真实性。

上海钢联制定了规范的样本审核流程，通过标准化工作表、OA 呼叫中心的录音查询功能、微信群留痕等方式对采集到的有样本价格相关信息进行核查，此外在价格数据处理环节设置了离群值的剔除筛查机制，以保证价格信息的真实性，并将核实记录上传至网盘。

4.对已发布的价格指数，若存在错误，能够做到及时发现，第一时间纠正，并在指数发布渠道显著位置予以披露

上海钢联拥有一套完整的价格发布审核流程，对已发布的价格，若存在错误，能够做到及时发现，第一时间纠正。另外，上海钢联通过电话、邮箱和信件等客户投诉渠道，能够第一时间接到错误投诉，并促进我们对已发布的价格错误进行纠正。

如现已发布的价格有错误，会在铁矿石频道页面(https://www.mysteel.com/notice/?dataId=0311) 的通知栏位置立即发布通知以提醒市场并修改错误的数值。

截止到 2023 年年底，上海钢联铁矿石事业部在本年度未出现价格或者指数存在错误的情况。

5.对所涉及的价格信息、工作人员信息、主观判断依据和结果、离群值或可疑交易排除等所有信息全部归档

上海钢联将价格相关的所有信息全部归档，所有文档存储在限制访问的安全可靠的网盘上，同时在公司内部的网盘中备份。

上海钢联建立了价格数据采集的组织架构，每年进行价格采集人员的信息更新，并按照公司合规规定进行价格采集人员的年度培训。所有的人员信息及培训记录均有归档留存。

上海钢联对价格行使的所有专家判断依据和结果都在价格计算表里有相应的体现，价格计算表均有上传网盘留存归档；

上海钢联对价格离群值或可疑交易排除的记录都在价格计算表里有相应的体现，价格计算表均有上传网盘留存归档。

6.归档信息保存不少于3年

在《办法》正式实施后，上海钢联将严格按照归档信息不少于 3 年的管理要求进行信息保存。

7.内部控制流程对价格指数行为进行内部审查，对价格指数履行审核和授权发布程序

上海钢联《指数管理委员会》章程中明确了总体及方法论、数据提交、治理相关的专项职责。包括价格采集人员、计算人员和销售人员的隔离措施和监督机制，价格审核评估程序、授权发布程序，以及内部控制流程的定期审查和更新机制等。在价格尚未发布前，不得以任何形式泄露有关价格的信息，经价格负责人审核后方可发布。

五、价格指数自我评估的完整性

1.于每年第一季度对上年度价格指数开展自我评估

上海钢联在《重要商品和服务价格指数行为管理办法（试行）》发布后积极学习并对标，建立了自我评估报告的模板，并于每年一季度对上海钢联价格指数开展自我评估，并将自我评估结果在发布渠道显著位置对外公开发布。

2.自我评估内容完整，包括价格指数行为主体条件、编制方案调整和执行情况、价格指数发布和信息披露情况、运行维护的规范性和独立性情况等

上海钢联在《重要商品和服务价格指数行为管理办法（试行）》发布后积极学习对标，建立了自我评估报告的模板，包括价格指数行为主体条件、编制方案调整和执行情况、价格指数发布和信息披露情况、运行维护的规范性和独立性情况等，以保证上海钢联价格的自我评估报告符合《办法》要求。

3.采集的所有价格信息进行核实，并有核实记录

上海钢联铁矿石价格指数团队会核实每项成交、询盘和报盘提交的细节以及相关可成交价格，包括产品类型、化学规格、产地、数量、价格、交货日期和交货港，以确保每份价格指数样本的真实性。

上海钢联制定了规范的样本审核流程，通过标准化工作表、OA 呼叫中心的录音查询功能、微信群留痕等方式对采集到的有样本价格相关信息进行核查，此外在价格数据处理环节设置了离群值的剔除筛查机制，以保证价格信息的真实性，并将核实记录上传至网盘。

4.对已发布的价格指数，若存在错误，能够做到及时发现，第一时间纠正，并在指数发布渠道显著位置予以披露

上海钢联拥有一套完整的价格发布审核流程，对已发布的价格，若存在错误，能够做到及时发现，第一时间纠正。另外，上海钢联通过电话、邮箱和信件等客户投诉渠道，能够第一时间接到错误投诉，并促进我们对已发布的价格错误进行纠正。

如现已发布的价格有错误，会在铁矿石频道页面(https://www.mysteel.com/notice/?dataId=0311) 的通知栏位置立即发布通知以提醒市场并修改错误的数值。

截止到 2023 年年底，上海钢联铁矿石事业部在本年度未出现价格或者指数存在错误的情况。

5.对所涉及的价格信息、工作人员信息、主观判断依据和结果、离群值或可疑交易排除等所有信息全部归档

上海钢联将价格相关的所有信息全部归档，所有文档存储在限制访问的安全可靠的网盘上，同时在公司内部的网盘中备份。

上海钢联建立了价格数据采集的组织架构，每年进行价格采集人员的信息更新，并按照公司合规规定进行价格采集人员的年度培训。所有的人员信息及培训记录均有归档留存。

上海钢联对价格行使的所有专家判断依据和结果都在价格计算表里有相应的体现，价格计算表均有上传网盘留存归档；

上海钢联对价格离群值或可疑交易排除的记录都在价格计算表里有相应的体现，价格计算表均有上传网盘留存归档。

6.归档信息保存不少于 3 年

在《办法》正式实施后，上海钢联将严格按照归档信息不少于 3 年的管理要求进行信息保存。

7.内部控制流程对价格指数行为进行内部审查，对价格指数履行审核和授权发布程序

上海钢联《指数管理委员会》章程中明确了总体及方法论、数据提交、治理相关的专项职责。包括价格采集人员、计算人员和销售人员的隔离措施和监督机制，价格审核评估程序、授权发布程序，以及内部控制流程的定期审查和更新机制等。在价格尚未发布前，不得以任何形式泄露有关价格的信息，经价格负责人审核后方可发布。

六、价格指数转让和终止的规范性（仅适用于评估审核时限内存在转让或终止情形的价格指数转让）

1.转让价格指数的，转让方与受让方签订转让协议，并移交所有归档信息档案。转让行为未发生在整改期间。受让方符合《办法》第六条、第七条规定

截止 2023 年年底，上海钢联铁矿价格没有出现转让的情况。

如果出现转让价格的情况，上海钢联会与受让方签订转让协议，并移交所有归档信息档案。受让方需符合《办法》第六条、第七条规定。

2.终止价格指数的，至少提前 30 个工作日在指数发布渠道显著位置发布终止公告。在终止之日前，继续运行维护和发布价格指数。终止后，归档信息保存至《办法》规定期限

如果出现终止价格的情况，上海钢联会至少提前 30 个工作日在铁矿石频道页面(https://www.mysteel.com/notice/?dataId=0311) 发布终止通知，在终止前将正常发布，终止后将严格按照归档信息不少于 3 年的管理要求进行信息保存。

截止到 2023 年年底，上海钢联铁矿石事业部发布过停更通知：国产矿：2023 年 6 月 5 日停更部分地区球团和精粉价格行情（7 条）

图 20 停更通知

关于Mysteel计划停更部分地区球团和精粉价格行情的通知

致Mysteel会员单位：

自 2023 年以来，由于安徽芜湖 55% 球团、山西代县62%球团、65%球团，湖北鄂州62%球团，山东沂水63%球团，河北天铁 69% 精粉，山西星源65%精粉行情有品种停产，停采，企业关停等原因，使价格缺少样本支撑，因此 Mysteel 经过面向球团厂及钢厂进行了市场意见征询并取得支持之后，在此决定将于 2023 年 6 月 5 日起，在网站页面停更上述品种涉及到的价格行情，具体停更情况如下：

球团行情价格：

地区	品位	价格属性	备注
安徽芜湖	55%球团	含税现汇出厂价	竖炉
山西代县	62%球团	含税现汇出厂价	久力球团厂
山西代县	65%球团	含税现汇出厂价	久力球团厂
湖北鄂州	62%球团	含税现汇出厂价	武钢资源鄂州球团公司
山东沂水	63%球团	含税现汇出厂价	鲁南矿业

钢厂行情价格：

地区	钢厂	品位	价格属性
河北邯郸	天铁	69%	干基含税到厂
山西临汾	星源	65%	干基含税到厂

七、严重违规事项

上海钢联铁矿石价格指数团队严格遵循《办法》进行价格信息的编制工作，没有损害国家利益或社会公共利益、编造发布虚假价格 指数、操纵价格指数、利用价格指数组织相关经营者达成价格垄断协议的行为，没有伪造或编造归档文件和评估报告、不配合价格主管部门评估和合规性审查以及与相关市场主体进行不当利益交换的行为，也没有价格指数行为主体及其实际控制人和高级管理人员参与价格指数所反映的商品和服务市场的交易或其他严重违 反《办法》规定的其他行为。

上海钢联电子商务股份有限公司

二〇二四年三月十二日