上海钢联建筑钢材价格指数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（以下简称“Mysteel”或“上海钢联”）对所编制的建筑钢材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

上海钢联是一家独立的第三方资讯机构，主要围绕价格、数据、快讯、分析、咨询、会务六大板块提供服务，不参与市场交易。

目前上海钢联建筑钢材价格体系主要覆盖螺纹钢、高线、盘螺、圆钢、冷轧带肋钢筋、高强螺纹钢、精轧螺纹钢、细晶粒螺纹钢、钢筋焊接网片等品种。根据市场使用场景，建筑钢材价格行情分为市场价格、工程采购价格等类型。根据市场需求，上海钢联还编制了上海螺纹钢价格指数、昆明建筑钢材价格指数以及晋南线盘价格指数区域性价格指数。

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，我们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企业微信、邮件等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及数据加工平台，所有价格指数相关的留痕都在网盘及数据加工平台上进行，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。

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

上海钢联严格按照《办法》的要求，规范了价格名称的编制，并起草了《价格表单标准格式的管理办法》等规范文件。如市场类价格行情表单格式为“XX 市场建筑钢材价格行情”等。

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。基于调研的结果，我们会形成价格编制的背景和目的，发布于《Mysteel 建筑钢材价格指数方法论》的相应章节。

上海钢联所发布的建筑钢材价格，对所反映的对象和范围，在我们的《Mysteel 建筑钢材价格指数方法论》中有清晰的界定。

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。

上海钢联在编制建筑钢材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及优先级

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、询盘和可成交。上海钢联不仅收集成交价格，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 建筑钢材价格指数方法论》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，也会使用询盘、报盘和可成交。同时详细规定了样本层级，在没有收到足够的成交时，保留使用专家判断的权利，包括参考其他市场信息，如供需基本面和影响建筑钢材价格的其他因素等。

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。

5. 明确价格指数发布方式和频率

上海钢联建筑钢材价格通过钢材频道页面、APP 等途径发布，

于每个工作日早上 09:00 至下午 17:30 之间更新，根据市场情况每日发布 1-3 次。

6. 相对价格指数有明确的基期基点

上海钢联建筑钢材相对价格指数均有明确的基期基点，其中 Mysteel 螺纹钢相对价格指数的基期时间为 2000/7/31，基点为：100；Mysteel 线材相对价格指数的基期时间为 2000/7/31，基点为：100。

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。建筑钢材价格团队会核实每项成交、询盘、报盘和可成交提交的细节，包括品牌规格、交易数量、商业条款，以确保每份价格样本的真实性。价格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当样本采集点无相关成交或样本停产而没有实际交易的情况。

2023 年，上海钢联建筑钢材价格行情编制过程中没有使用主观判断的情况。

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

上海钢联价格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 1.5 倍四分位差离群值判定法则排除离群值价格数据。

2023 年，上海钢联建筑钢材价格没有出现离群值或可疑交易，也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

上海钢联在所有钢材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。

上海钢联钢材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

上海钢联在钢材频道页面（https://gc.mysteel.com/）的显著位置发布了《Mysteel 建筑钢材价格指数方法论》，同时在指数页面相应位置也有公开发布。

https://www.mysteel.com/notice/?dataType=6

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等

上海钢联在相应指数日报以及行情价格表单上方开辟专栏，展示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，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等。

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。

① 官方投诉电话：021-26093100，公布于所有价格表单下

方；

② 官方投诉邮箱：complaints@mysteel.com；

③ 官方投诉地址：上海市宝山区园丰路 68 号上海钢联电子商务股份有限公司，指数管理委员会收，200444，中国。

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

如果收到利益相关方有关价格的投诉，上海钢联建筑钢材价格团队将严格按照《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。

2023 年投诉处理情况：

2023 年，上海钢联建筑钢材价格团队共计收到了 13 次投诉，投诉负责人均按照公司文件指导在规定时间内进行了调查处理，并将最终结果与投诉方沟通，涉及到相关利益者的投诉也发布了相应的通知，最终处理结果已按规定登记在册。

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《办法》发布后积极学习并对标，并在 2024 年初更新了建筑钢材价格指数自我评估报告，于 2024 年一季度公开发布。

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）

上海钢联建筑钢材价格在2023年共计新增发布了8条价格行情，分别于2023年3月24日新增发布了江西市场冷轧带肋钢筋价格行情，2023年6月9日新增发布了济南市场钢筋网片价格行情， 2023年8月30日新增发布了滨州市场建筑钢材价格行情,2023年10月8日新增发布了北海市场建筑钢材价格行情、韶关市场建筑钢材价格行情，2023年10月27日新增发布了成都市场钢筋网片价格行情，2023年12月4日新增发布了肇庆市场建筑钢材价格行情，2023年12月26日新增发布了天津市场钢筋网片价格行情，并按照《办法》要求在发布前均采取了超过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、采集频次等具体要求。同时，在《Mysteel建筑钢材价格指数方法论》及样本数据表内规定了包括品牌规格、

交易数量、商业条款。

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表。

上海钢联价格信息提交方式包括 OA 呼叫系统、微信、企业微信、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

上海钢联建筑钢材价格团队会核实每项成交、询盘、报盘和可成交提交的细节，包括品牌规格、交易数量、商业条款，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所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。

如发现已发布的价格有错误，会在钢材频道页面(https://gc.mysteel.com/)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。

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. 按照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《办法》发布后积极学习对标，初步建立了自我评估报告的模板，并按照《办法》要求于2024年一季度开展自我评估。

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《办法》发布后积极学习对标，初步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。

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

截止目前，上海钢联钢材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

上海钢联于 2023 年 1 月 1 日对外发布《关于计划过渡停更 Mysteel 上海抗震螺纹钢价格指数的通知》，并于 2023 年 4 月 1 日起正式停更上海抗震螺纹钢价格指数。

截止目前，上海钢联建筑钢材价格指数针对终止的情况，均会至少提前 30 个工作日在钢材频道页面(https://gc.mysteel.com/) 或通知频道页面（https://www.mysteel.com/notice/）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。

七、严重违规事项

上海钢联建筑钢材价格团队严格遵循《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/编造归档文件/评估报告、不配合价格主管部门评估和合规性审查、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

二〇二四年三月二十八日