



上海钢联煤炭价格 2023 年度自我评估 报告

上海钢联电子商务股份有限公司

二〇二四年三月

目 录

一、 价格指数行为主体	1
二、 价格指数的编制方案完整性和科学性	3
三、 价格指数发布透明性和完整性	8
四、 价格指数运行维护	10
五、 价格指数自我评估的完整性	13
六、 价格指数转让和终止的规范性	13
七、 严重违规事项	14

总则

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煤炭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。

目前上海钢联煤炭价格体系主要覆盖炼焦煤、无烟煤、动力煤、喷吹煤等品种，除炼焦煤、喷吹煤有编制价格指数外，其他均未编制价格指数。根据市场使用场景，煤炭价格行情分为市场价格、港口价格、进口价格及采购价格等类型。

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，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,上海钢联煤炭价格团队暂未收到任何与煤炭价格相关的投诉。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

Mysteel 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, Mysteel 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 煤焦价格指数方法论》进行具体的细化描述和公开披露。

Mysteel 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:XX市场动力煤价格行情。

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 煤焦价格指数方法论》的相应章节。

上海钢联所发布的煤炭价格,对所反映的对象和范围,在我们的《Mysteel 煤焦价格指数方法论》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。

上海钢联在编制煤炭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、报盘和询盘。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 煤焦价格指数方法论》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加权平均值。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煤炭价格的其他因素等。

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。

上海钢联煤炭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、询盘及报盘）权重的计算，按照成交量加权平均；第二步，最终的价格指数权重是特定，在《Mysteel 煤焦价格指数方法论》对其有具体的细化描述和公开披露。

5. 明确价格指数发布方式和频率

上海钢联煤炭价格通过煤炭频道页面、APP 等途径发布，除部分重要市场价格每工作日上午 09:00 和下午 17:30 发布两次外，其他市场价格每工作日仅发布一次。

6. 相对价格指数有明确的基期基点

上海钢联煤炭价格均为绝对价格，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。煤炭价格团队会核实每项成交、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

Mysteel 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。

合理条件：Mysteel 仅在因政策（唯一）原因导致市场长期无流动性的条件下才会使用主观判断。

主观判断使用的方法：在使用主观判断的过程中，Mysteel 将依据相关品种或相关市场的波动情况做相应的调整。例如某一市场的价格指数根据相关联市场的调整幅度情况做相应的同步调整。

Mysteel 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 2023 年底，Mysteel 煤炭价格团队并未对任何远期或国产煤炭价格指数有主观判断的现象。

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

上海钢联煤炭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 倍四分位差异常值判定法则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。

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是：

（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，上海钢联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，上海钢联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，上海钢联煤炭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

上海钢联在所有煤炭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>

上海钢联煤炭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

Mysteel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。

Mysteel在煤炭频道(<https://coal.mysteel.com/>)页面“导航栏”建立了“煤焦价格指数方法论”的查阅通道，并在页面“导航栏”、“通知栏”及指数页面

(https://index.mysteel.com/xpic/detail.html?tabName=ji_aotan)等显著位置公开披露了价格指数编制方案及调整情况。

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

自 2021 年 6 月 17 日《重要商品和服务价格指数行为管理办法（试行）》发布后，Mysteel 积极学习和自查，自 2022 年 2 月 11 日起在网站煤炭价格表单同一位置同步披露了价格指数最新值的简要计算基础和过程。

披露模板：价格信息采集点的数量 XX 个、样本量 XX 个、成交量 XX 万吨、价格范围 XX-XX 元/吨和平均值 XX 元/吨，使用数据形式百分比：成交数据占比 60%、询盘数据占比 20%、报盘数据占比 20%，有/无离群值，有/无主观判断。

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，上海钢联煤炭价格团队没有收到来自任何利益相关方有关价格的投诉。如果收到投诉，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。

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 Mysteel 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）

上海钢联煤炭价格在《办法》生效后，2023 年编制发布《Mysteel 喷吹煤远期现货价格指数》及《Mysteel 炼焦煤远期现货价格指数》，并在发布前试运行不少于 6 个月。

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 煤焦价格指数方法论》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表。

上海钢联价格信息提交方式包括 OA 呼叫系统、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

上海钢联煤炭价格团队会核实每项成交、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，能够第一时直接到错误投诉，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，会在煤炭频道页面 (<https://coal.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. 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《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 Mysteel 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。

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 年底，上海钢联煤炭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

截止 2023 年底，上海钢联煤炭价格没有出现终止的情况。

如果出现终止价格的情况，上海钢联会至少提前 30 个工作日在煤炭频道页面 (<https://coal.mysteel.com/>) 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

上海钢联煤炭价格团队严格遵循《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日