



莒南花生价格指数方法论

目 录

一、编制背景及行为主体	3
1、编制背景	3
2、行为主体	3
3、编制团队	4
4、运行时间	4
5、专家评审	4
二、编制目的与意义	5
三、标准货物	5
1、指数名称	5
2、交易品质	6
3、标准交易	6
4、价格类型及条件	7
四、数据采集	7
1、价格信息来源	7
2、数据优先级及提交细节	7
3、数据采集方法	8
4、数据核实	8
5、记录保存	10
五、指数计算	10
六、指数发布	11
1、发布时间	11
2、勘误	11
3、澄清数据请求	11
4、投诉	11
七、其他	12
1、调整	12
2、评估	12
3、审查	12
4、转让	13
5、终止	13

一、编制背景及行为主体

1、编制背景

莒南地处鲁东南苏鲁交界处，总面积 1752 平方公里，耕地面积 113.6 万亩，辖 16 个镇街，108 万口人。莒南是传统的花生种植大县，产业链条完备，产品品质优良，先后被评为全国花生生产出口基地县、国家农业产业化示范基地县、山东省首批农产品出口产业集聚区、山东省优质花生基地县。目前，花生种植面积常年保持 40 万亩以上，年产 15 万吨以上，现有花生生产加工企业 280 余家。莒南的花生产业有四大优势：一是产品种类高端。花生产品涉及花生油、花生乳白仁、花生酱、花生饮料等 12 大类 30 多个品种，销往国内 20 多个省市并远销东南亚、中东、欧盟、美洲等 50 多个国家和地区。二是品牌优势突出。“莒南花生”是“中欧互认农产品地理标志”之一，2020 年，入围《中欧地理标志协定》首批名单。三是对外贸易繁荣。拥有自营进出口权花生加工企业 77 家，其中获得欧盟注册企业 5 家、美国 FDA 验厂检查企业 1 家，是全国最大的花生商品生产基地和出口贸易集散地。四是带动作用明显。龙头示范企业充分发挥优势，强化联农、带农，推动产业整合提升，打造以龙头企业为引领的省级花生产业集群，全年花生产业预计实现产值 376 亿元。

无论从种植、加工、还是贸易层面来看，莒南县的花生产业在国内市场有着重要的地位和市场影响力，编制一支以莒南花生为标的的价格指数意义重大。

2、行为主体

莒南花生价格指数的行为主体为莒南县发展和改革局。

3、编制团队

2020年12月,莒南县发展和改革局与上海钢联电子商务股份有限公司(上海钢联)签订战略合作协议,委托上海钢联编制莒南花生价格指数,编制工作由上海钢联子公司山东隆众信息技术有限公司(隆众资讯)具体执行,数据收集工作由上海钢联农产品事业部完成。

上海钢联制定指数团队内部控制流程,流程中包含指数团队相关人员的隔离措施和监督机制、价格指数审核评估程序、授权发布程序、内部控制流程的定期审查和更新机制等内容。

上海钢联内设指数管理委员会和指数合规部两个部门,提供指数编制全方位的质量保障。严格遵守独立性、公平性、透明性原则,恪守客观中立保障制度。

为确保莒南花生价格指数的顺利研发和平稳运行,临沂市发展和改革委、莒南县发展和改革局抽调部分人员与上海钢联有关人员联合组成了莒南花生价格指数管理委员会,主要负责莒南花生价格指数的编制、调整、解读以及指数的运行维护监管。

4、运行时间

指数项目自2020年12月开题,在上海钢联完成数据采集及审核、数据存储及运算、指数编制、发布流程及前后台支持等主体工作后,于2021年4月进入试运行。

5、专家评审

2021年12月4日,山东省价格认证中心组织召开“莒南花生价格指数”评审会,

经课题组汇报、专家组评议，形成以下意见：

“莒南花生价格指数”编制技术方案合理，指数编制方法规范，指数样本选取具有代表性，数据来源及时准确。该指数经试运行，能够反映莒南花生的价格水平及变动趋势，对产业发展、农民增收及市场交易具有较强的指导意义。

经专家组评议，一致同意该项目通过验收。

二、编制目的与意义

首先，有利于推动市场主体品牌形象的打造，增强品牌知名度。莒南花生价格指数是莒南花生行业迈向标准化的有效途径。

其次，莒南花生价格指数的顺利发布可以提升莒南花生在市场价格形成机制中的参与权、表达权，从而提升莒南花生在国内外的市场竞争力，扩大其行业影响力。

最后，莒南花生价格指数作为行业风向标，可以为政府部门决策提供依据，打造政府良性监管体系，提高监管水平。通过莒南花生价格指数，实现对莒南花生生产、流通、消费环节的价格监测和预警，政府可以准确把握行业变化趋势、波动规律及传导机制，从而全面了解市场量价走势并对市场的异常波动做出预警，为各级政府的防范及应对策略提供重要依据。

三、标准货物

1、指数名称

莒南花生价格指数

2、交易品质

企业名称	油料花生收购指标
金胜粮油	1、水分 \leq 9.0%。 2、酸值 \leq 1.0%；霉变粒 $<$ 2。 3、杂质 \leq 1.0%。 4、含油 \geq 42.30%。 5、1-4级出成（7个筛） \geq 40%。 6、筛下（5.5筛） \leq 20%。 7、黄曲霉毒素 B1 \leq 20uk/kg。
玉皇粮油	1、含油 \geq 43%。 2、水分 \leq 9%。 3、杂质 \leq 1.0%。 4、酸值 \leq 1.0%。 5、霉变 \leq 1%。 6、7个筛上 \geq 45%。 7、5.5筛下 \leq 15%。
兴泉油脂	1、含油 \geq 43%。 2、酸值 \leq 0.8%。 3、出成 \geq 70%。 4、水分 \leq 10%。 5、杂质、霉粒为 0。 6、冻粒 5 以内。
绿地食品	1、水分 \leq 9.0%。 2、酸值 \leq 1.0%；霉变粒 $<$ 2。 3、杂质 \leq 1.0%1。 4、含油 \geq 42.30%。 5、1-4级出成（7个筛） \geq 40%。 6、筛下（5.5筛） \leq 20%。 7、黄曲霉毒素 B1 \leq 20uk/kg。

3、标准交易

■ 采集窗口期：交易日每天 00:00-24:00，收盘时间 16:00。

- 标准交易：不小于一车 30 吨

4、价格类型及条件

- 价格类型：小贩、贸易商销售给 4 家样本油厂的成交价
- 计价单位：元/吨
- 交割地：临沂市莒南县
- 样本覆盖率：按收购量计超过莒南 50%

四、数据采集

1、价格信息来源

序号	企业名称	企业简称	数据类型
1	金胜粮油集团有限公司	金胜	花生成交价格
2	山东玉皇粮油食品有限公司	玉皇	花生成交价格
3	山东兴泉油脂有限公司	兴泉	花生成交价格
4	山东绿地食品有限公司	绿地	花生成交价格

2、数据优先级及提交细节

- 数据优先级
 - 对市场公开的成交价格。
 - 从市场参与者处获悉的公开报道成交价格。
 - 对市场公开的实际询盘。
 - 对市场公开的实际报盘。
 - 与花生价格相关的其他数据，例如供需基本面和影响花生价格的其他因素。

其中成交价格优先级最高，当市场上存在公开的成交价格时，价格指数优先采用成交价格作为底层数据进行运算，询报盘价格仅在市场上缺乏公开的成交价格时参与指数的运算。

■ 数据提交细节

上海钢联严格把控提交收集过程，只考虑遵循标准合同条款的成交、报盘和递盘。上海钢联不仅收集提交的成交价格，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。如有必要，上海钢联可以要求提交者提供相关文件来判断合同的履行情况并验证数据的有效性。

3、数据采集方法

上海钢联收集的信息来源于国内生产企业、市场招标、国内交易平台、国内贸易公司和下游提交的成交、询盘和递盘信息，上海钢联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。

- 电话（呼叫中心）：数据采集团队使用呼叫中心系统，所有通过呼叫系统采集的数据均保留通话录音，以保证所有历史数据可以优选追溯及校准。数据采集人员不得使用私人固话或手机采集数据。

- 电子邮件：通过 mysteel.com 域名的邮件提交有效数据。

- 即时消息软件：通过网络即时聊天工具采集并完整保存聊天记录。

4、数据核实

■ 数据：上海钢联希望收集尽可能多的数据，包括成交、报盘和递盘等。上海钢联尽

可能确认并深入分析提交中的数据，并鼓励所有市场参与者成为上海钢联价格的提交者，因为更广泛的数据能提高价格的准确性。

上海钢联会核实每项成交、询盘提交的细节，包括产地、数量、价格和交货地，以确保每份上海钢联花生价格样本的真实性。所提交的内容均来源于市场，并妥善加以详细记录，以确保其高质量和可靠。所收到的不完全符合上海钢联所规定要求的提交内容，不能被纳入价格计算。如有必要，上海钢联可以要求提交者提供相关文件来判断合同的履行情况并验证数据的有效性。

■ **异常值：**上海钢联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、交货地和价格，上海钢联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。上海钢联将对事实数据进行充分验证及统计，然后通过 3%置信区间异常值判定法则排除异常值，异常值处理应遵循事实，不可在方法论规则外剔除事实数据。

■ **样本：**数据采集人员每年 12 月最后一周（含至少三个工作日的）对样本企业进行审核，当样本企业出现不适合作为样本企业的情况时，数据采集人员在对本企业情况充分证实的基础上及时提交剔除样本企业申请，经隆众资讯指数研发中心审批通过后即时剔除。

如市场新增样本企业符合要求，则由数据采集人员提交增加样本企业申请，经隆众资讯指数研发中心审批通过后试运行三个月，如无异常，正式作为指数样本企业。

■ **数据源：**数据采集人员实时监测数据源变动情况，如数据源出现职责调动或离职等情况，将于数据源产生变化当日 16:00 前对样本做出调整。

5、记录保存

无论采用何种收集渠道，电话、电子邮件或是基于互联网的即时通信工具，上海钢联会存档记录与提交者的所有通信，时长 5 年，确保指数中使用的所有提交信息都可以追溯到原始记录。

五、指数计算

莒南花生价格指数采用 $P=(\sum \rho \omega)/\sigma \times 100$ 的运算式子。

式中， ρ 为样本企业在采价窗口期内，由数据源报出的数据采集人员无差错录入的唯一价格； ω 为权重； σ 为基值。

为保证指数稳定性，选取近 3 年各样本企业花生收购量加权平均值作为指数权重，花生收购量加权平均值计算公式为： $R=R_{n-1}*50\%+R_{n-2}*30\%+R_{n-3}*20\%$

指数权重于每年 4 月 1 号进行调整，2021 年选取 2018 年、2019 年、2020 年各样本企业花生收购量加权平均值作为指数权重，因此 2024 年选取 2021 年、2022 年、2023 年各样本企业花生收购量加权平均值作为指数权重。此次调整后金胜、玉皇、兴泉、绿地花生收购价格权重分别为 36.20%、23.84%、27.18%、12.78%，调整前金胜、玉皇、兴泉、绿地花生收购价格权重分别为 34.70%、26.12%、27.99%、11.19%。

花生于每年七月开始陆续停收，到当年九月又开始陆续收购，在此期间各样本企业根据自身情况调整收购策略，届时将根据实际情况再调整权重。

根据基期的选择原则及方法，选定 2019 年 7 月为基期，基值为 8655，基点为 100。

六、指数发布

1、发布时间

交易日每天 17:00 发布当天指数。

发布时间可能受到各种紧急情况和不可抗力的影响，如停电、自然灾害和恐怖活动。若发生这种情况，莒南县发展和改革委员会将尽力尽早发布公布。

2、勘误

如果发现错误，无论是由于不正确提交还是计算错误，经上海钢联及莒南县发展和改革委员会核实，都会立即发布公告来更改错误数值。

3、澄清数据请求

上海钢联始终致力于为客户提供最优质的服务。客户可能会就上海钢联的样本收集方法、计算方法、计算标准化流程等提出问题如果客户需要额外信息，例如某些数据或计算方法的详细介绍。请通过 <https://www.mysteel.com> /或发送邮件至 complaints@mysteel.com 联系我们。

4、投诉

为有效的监督资讯行业各项业务规范化管理，上海钢联设立投诉反馈机制，力保证数据输出的准确性，欢迎广大社会行业从业者进行投诉监督。

客户或利益相关者对上海钢联提供的上海钢联价格的某些方面有所不满的可能会投诉。Mysteel 处理投诉详情可以在 Mysteel 投诉处理政策中找到。Mysteel 投诉处

理政策和投诉信息披露都可通过向 complaints@mysteel.com 发送电子邮件或者在 Mysteel 投诉页面 <https://www.mysteel.com/feedback/index.html> 中找到。

七、其他

1、调整

当指数方案不足以反映市场真实情况，或与国家、地方政策存在冲突时，隆众资讯指数研发中心将对指数方案进行调整。一般情况下，莒南县发展和改革委员会将在方案调整前 45 个工作日在指数发布渠道显著位置发布指数方案调整声明，并公开征集指数使用方对新版方案的意见及建议。

2、评估

莒南县发展和改革委员会委托隆众资讯于每年第一季度对上年度价格指数按照《重要商品和服务价格指数行为管理办法》的相关规定开展自我评估，评估内容包括：莒南县发展和改革委员会、上海钢联、隆众资讯应当具备条件的满足情况、编制方案的调整和执行情况、指数发布和信息披露情况、指数运行的规范性和独立性情况以及信息归档情况。并在指数发布渠道显著位置对外公布评估结果。

3、审查

莒南县发展和改革委员会将积极配合相关部门的审查并接受指导，若评估和合规性审查中发现不合规行为，莒南县发展和改革委员会可委托隆众资讯按照价格主管部门的意见进行整改，并提交整改报告。

4、转让

莒南县发展和改革局与受让方签订价格指数转让协议，并移交所有归档信息档案。价格指数在整改期间不得转让。

5、终止

莒南县发展和改革局可以视情况终止价格指数，但应当履行以下责任：

- 至少提前 30 个工作日在指数发布渠道显著位置对外发布终止公告；
- 在终止之日前继续运行维护和发布价格指数；
- 归档信息保存至少 5 年；
- 价格主管部门规定的其他事项。