

2023 年度上海出口集装箱结算运价指数（SCFIS）

自我评估报告

为确保上海航运交易所（以下简称“上海航交所”）编制的上海出口集装箱结算运价指数（以下简称“SCFIS 指数”）符合国家发改委《重要商品和服务价格指数行为管理办法》（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，上海航交所按照《办法》中的要求，对编制的 SCFIS 指数进行 2023 年度自我评估，评估结果符合《办法》要求。

一、价格指数行为主体独立性和专业性

1、独立的第三方

上海航交所是经国务院批准、由交通运输部和上海市人民政府共同组建，于 1996 年成立的事业单位，是我国政府为了培育和发展中国航运市场、配合上海国际航运中心建设所采取的重大举措。上海航交所是独立的第三方，不参与航运现货市场交易，与集装箱运输服务供应方、需求方不存在直接或间接控股情形（包括绝对控股和相对控股），不存在被同一第三方直接或间接控股情形（包括绝对控股和相对控股）。不存在高级管理人员一半以上由另一方委派的情形。

2. 运价信息来源合法稳定

上海航交所采集的运价信息为符合运价定义的全部真实成交数据，运价定义见《上海出口集装箱结算运价指数编制规则（暂行）》（以下简称“《编制规则》”）。上海航交所成立了中国出口集装箱运价指数编委会欧美航线分委会，制定了《中国出口集装箱运价指数编委会欧美航线分委会规则》，明确成员单位与价格指数行为主体上海航交所的权利和义务，其中委员单位要真实、准确、及时地向上海航交所提供运价信息，接受上海航交所的数据校验。上海航交所还与欧美航线分委会成员单位签订了《上海出口集装箱结算运价指数数据采集技术对接协议》，委员单位全部通过 API 接口系统自动采集运价数据。

3. 建立了完善的组织架构，配备专业人员和设施

(1) 组织架构

上海航交所建立了完善的内外部治理体系。其中党委会和总裁办公会负责指数的战略和决策；各类委员会和专门小组负责各类专项工作和监督管理；业务职能部门负责指数的日常运营。

指数专家委员会：负责对 SCFIS 指数编制方法、规则和实施细则的制定与变更、涉及指数运作和业务发展的事项等提供专家意见。指数专家委员会相关信息可在上海航交所官网获取。

指数业务监督委员会：负责对 SCFIS 指数编制及治理的各个方面进行监督管理。指数业务监督委员会每季度召开例会，每年向党委会提交专项报告。指数业务监督委员会中包含 1 名外部成员，由上海航交所聘请，委员名单及指数业务监督委员会的资质职权可在上海航交所官网获取。

指数编委会：中国出口集装箱运价指数编委会及欧美航线分委会成员单位负责根据《中国出口集装箱运价指数编委会章程》和《中国出口集装箱运价指数编委会欧美航线分委会规则》，真实、准确、及时地向上海航交所提供运价信息，接受上海航交所的数据校验。

信息部：跟踪研究国内外各类指数的发展状况和编制方法，编制开发系列指数，对指数规则进行优化和完善。负责指数编委会的组织管理，编委单位系统自动报送数据的定期校验，指数管理及维护规则研究，指数运行维护及沟通。

技术部：根据业务需要组织开发系统，计算与发布指数，确保指数系统安全运行，建立并维护与编委单位的系统对接、负责系统校验工作，为客户提供数据与技术服务，负责相关数据校验服务供应商的管理。

市场部：负责指数业务监督委员会的日常联络与维护，SCFIS 指数相关利益冲突的总体防范与管理。

总裁办：对人事、法务、行政及后勤服务等方面的工作进行管理，协调指数

专家委员会，服务、协调、支持各业务部门开展工作。

(2) 专业人员

上海航交所长期致力于航运指数的编制和发布，运价指数编制人员具有多年的从业经验。上海航交所设置了专门的小组，配备专业的人员参与 SCFIS 指数的日常运行和风险控制。指数应急领导小组全面负责 SCFIS 指数应急情形处理的领导和管理；指数应急编制小组负责应急情形下的编制和发布、数据灾备等；指数风险管理小组负责 SCFIS 指数运营、市场操纵、系统和信息安全等风险的识别、监控、防范和处置工作，定期向指数业务监督委员会提交风险评估报告。

除此之外，上海航交所依据既定程序和标准招聘及录用员工，为员工提供各类培训项目（包括岗位培训），每半年开展员工考评。上海航交所要求所有员工入职时及此后每年签署承诺书，要求所有特定人员每年签署合规声明及承诺书，以确保员工了解指数业务相关要求及遵守各类行为规范。

(3) 设施

上海航交所制定了《上海航运交易所指数应急办公室管理办法》，配备了结算运价指数应急办公室，应急办公室配备门禁系统、电话录音、摄像监控等保密设施。部署实施“两地三中心”系统，包括航交所主站点和同城异地灾备站点。站点之间实时同步数据，底层通过点对点专线通讯。上海航交所主站点配备多线网络链路实现高可用性，防火墙、WAF、反向代理负载均衡均部署由多台设备实现高可用性。灾备站点防火墙、WAF、反向代理负载均衡设备均实现高可用性。

4. 建立了完备的内部控制流程以及投诉、咨询、举报的渠道和处理机制

(1) 内部控制流程

上海航交所制定的《编制规则》，明确了 SCFIS 指数计算方法、指数发布时间、样本调整、权重调整、应急处理等。上海航交所每年定期对《编制规则》进行审阅，上海航交所通过审视市场环境、听取指数专家委员会建议、接受市场反馈、外部投诉等途径，发现需要修订规则的情形。上海航交所制定了《上海航运交易所

指数规则修订实施办法》以规范 SCFIS 指数修订流程。上海航交所对《编制规则》等内部控制机制定期进行审查。

SCFIS 指数的运价信息采集为 API 方式系统自动采集，指数应急编制小组成员（价格指数计算人员）和运价指数销售人员岗位互不重叠、互不隶属。相关岗位人员绩效考核、职务晋升等不直接或间接与指数高低挂钩。

(2) 投诉渠道和处理机制

上海航交所制定了《上海航运交易所指数业务咨询、投诉与举报管理办法》规范 SCFIS 指数相关的外部咨询与投诉处理流程，并设立了外部咨询与投诉处理工作小组，负责接收、调查及处理外部咨询与投诉。重要投诉的处理方案需提交总裁审批。工作小组定期汇总外部咨询与投诉的数量及处理情况，提交指数业务监督委员会审阅。

外部咨询与投诉电子邮箱地址为：claim@sse.net.cn，通过上海航交所官网对外公布。

二、 价格指数的编制方案完整性和科学性

运价指数的研发最重要的原则是遵循航运市场运行客观情况。上海航交所研发的 SCFIS 指数是基于客观的集装箱运输市场，通过了大量的市场调研、数据分析，形成了《上海出口集装箱结算运价指数研发报告》。

《编制规则》已公开发布在上海航运交易所官网，获取路径：<https://www.sse.net.cn/indexIntro?indexName=scfis>。2023 年，为进一步提高指数运行质量，在充分听取各方意见的基础上，经指数专家委员会审议通过，对《编制规则》进行修订，《编制规则》3.0 版于 2023 年 4 月 15 日实施。

5、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

《编制规则》对指数的编制背景和目的做出了详细的解释。《编制规则》对指数所反映的对象和范围做出了明确界定，包括指数名称、运价定义、样本数据类

型、样本数据来源等。上海航交所在设计 SCFIS 指数时充分地考虑了相关市场的规模，在市场调研工作中详细地调研了航运市场基本情况，包括主干航线、货物流向、市场参与者、市场规模、运价特征等情况。

6、有明确的、合理的价格信息采集点和代表规格品

《编制规则》明确了采集运价数据的特征以及对样本数据的具体要求。SCFIS 指数表征上海出口集装箱即期海运市场结算运价的变动方向和程度，结算运价是即期市场上经营欧洲、美西航线（以下简称“欧美航线”）市场份额合计超过 80% 以上的班轮公司，以及即期市场预付货年出运量 1000TEU 以上、能够保证每周具有稳定数量的成交且业务系统成熟的货代企业，船开后用于结算的运价。

7、明确计算指数使用的数据形式

SCFIS 指数全部采用成交运价数据计算指数。

8、明确数据权重和计算公式

为满足指数期货交易的需要，保证指数获取的数据真实性、准确性、可验证性，SCFIS 采用成交价格数据计算指数的比例为 100%，指数结果真实反映了上海口岸集装箱船开后用于结算的平均运价水平。

《编制规则》中详细描述了指数数据预处理、指数计算的步骤和相关计算公式，也包括箱型权重调整规则和权重换算系数的计算公式等。

9、明确指数发布方式和频率

SCFIS 指数在上海航交所官网每周一 15:05（北京时间）对外发布。

10、明确指数基期和基期点数

指数以 2020 年 6 月 1 日为基期，基期指数为 1000 点。

11、价格信息提交者约束措施

为保证数据采集的完整性、唯一性和一致性，样本公司通过系统对接方式以报文格式向上海航交所提交符合运价定义的所有成交运价信息。所有委员单位与上海航交所签订了《上海出口集装箱结算运价指数数据采集技术对接协议》。

上海航交所将符合要求的编委单位纳入 SCFIS 指数的样本公司，并共同签署《中国出口集装箱运价指数编委会章程》和《中国出口集装箱运价指数编委会欧美航线分委会规则》，以规范样本公司提交数据行为。上海航交所每季度根据《上海出口集装箱结算运价指数季度校验办法》对样本公司运价数据采集定义的执行情况、技术对接系统运行情况等进行校验，未通过季度校验的样本公司将会在下一季度采样筛选中剔除。

12、严格限定使用主观判断

《编制规则》要求 SCFIS 指数全部采用成交运价数据计算指数。2023 年指数计算中，没有采用主观判断的任何数据和相关情形。

13、有合理的离群值处理措施

上海航交所建立了检测潜在异常值和可疑提交数据的措施。对样本公司分箱型运价数据，采用格拉布斯（Grubbs，当运价样本数 <20 时）或者拉依达准则（ 3σ 准则，当运价样本数 ≥ 20 时）检验剔除离群值。

《编制规则》对单家样本公司箱量份额过大时进行了比例限制，分航线分箱型单家样本公司的箱量份额不得超过 50%。

三、价格指数发布透明性和完整性

14、公开上海航运交易所基本情况及变动情况

上海航交所作为价格指数行为主体，其基本情况及变动情况通过以下官网地址进行公布：<https://www.sse.net.cn/about#msg1>。

15、公开发布指数编制方案及调整情况

市场客户还可以通过上海航交所官方网站，包括“航运指数”、指数发布页面、指数简介/公告等导航栏，了解最新的指数编制规则，以及指数编制规则的变动情况。

16、公开发布指数计算基础和过程

上海航交所在官网指数栏的显著位置公布了《指数简介》，包括样本公司、

运价定义、计算编制方法、计算公式、发布时间等。

上海航交所在计算价格指数时，100%采用样本公司的成交数据，不存在主观判断的情况。

17、公开投诉受理渠道和处理机制

上海航交所制定了《指数业务咨询、投诉与举报管理办法》，设立外部咨询与投诉邮箱、内部举报邮箱和举报电话，由专人负责处理相关的投诉与举报。

18、投诉处理

2023 年度，未收到 SCFIS 指数相关投诉。

19、发布指数年度自我评估结果

2022 年度指数年度自我评估报告见航交所官网，网址：

https://www.sse.net.cn/cninfo/notice/index/202310/t20231017_1382191.jsp

20、试运行不少于 6 个月

试运行不少于 6 个月已经在首次评估中披露。

四、价格指数运行维护

21、完善的价格信息提交制度

上海航交所制定了报文规范（中英文版），与样本公司签订了《上海出口集装箱结算运价指数数据采集技术对接协议》，明确提交价格信息的标准、提交时间和提交方式等。

22、价格信息采集方式能够追溯查询

上海航交所制定了《上海出口集装箱结算运价指数季度校验办法》，建立季度校验机制。在 SCFIS 指数的样本公司业务生产系统中，对提交价格信息的完整性、真实性、准确性进行核实，并保存核实记录。

23、价格信息核实

通过季度校验，对前期提交的价格信息予以核实。

24、指数错误修正机制

上海航交所制定了《上海航运交易所指数错误修正办法》。对于已向市场发布的指数行情，若发现重大错误，经审慎评估并征求指数专家委员会意见后，由指数应急领导小组决定是否需要重新计算并发布。

2023 年度指数运行情况：SCFIS 指数未发现错误情况。

25、信息归档

上海航交所制定了《上海航运交易所指数档案管理办法》，将 SCFIS 指数相关工作或活动中要求保密留存或具有查考价值的文档、音频视频等资料归档，包括纸质档案、电子档案等。指数档案统一集中保管在专门保管场所。涉及运价数据、企业保密信息的文档及音频视频资料，保存在指数保密室或指定区域。原始运价数据、指数编制运行程序等，按信息系统安全运行的要求进行备份，并异地存放。

26、信息归档时限

指数档案的保管期限为 20 年。

27、内部审查

为保证 SCFIS 指数完整性和可靠性，上海航交所成立了指数业务监督委员会、指数风险管理小组，设置了合规岗，加强指数内部控制。指数业务监督委员会负责对 SCFIS 指数编制及治理的各个方面进行监督管理，每季度召开例会，每年向党委会提交专项报告。指数风险管理小组负责 SCFIS 指数运营、市场操纵、系统和信息安全等风险的识别、监控、防范和处置工作，定期向指数业务监督委员会提交风险评估报告。

五、价格指数自我评估的完整性

28、自我评估每年一季度完成

2023 年 10 月，上海航交所首次按《办法》完成 2022 年度自我评估，并公开评估报告。2023 年度自我评估工作于 2024 年 1 季度启动，并计划 3 月完成。

29、自我评估内容完整

自我评估按照《价格指数行为评估和合规性审查操作指南》开展，内容完整。

2024 年 1 季度开展 2023 年的自我评估工作。自我评估报告对外公开。

六、价格指数转让和终止的规范性

30、指数转让

2023 年度，上海航交所 SCFIS 指数无转让情况。

31、指数终止

上海航交所制定了《上海航运交易所指数终止办法》，明确 SCFIS 指数的终止情形、实施流程等。2023 年度，上海航交所 SCFIS 指数无终止情况。

七、严重违规事项

上海航交所严格遵循《办法》进行价格指数的编制运行。

32、不存在损害国家利益或社会公共利益的情形

33、不存在编造发布虚假价格指数的情形

34、不存在操纵价格指数的情形

35、不存在利用价格指数组织相关经营者达成价格垄断协议的情形

36、不存在伪造/编造归档文件/评估报告的情形

37、不存在不配合价格主管部门评估和合规性审查的情形

38、不存在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

39、不存在与相关市场主体进行不当利益交换的情形

40、不存在其他严重违反《办法》规定的其他行为

上海航运交易所

2024 年 3 月 21 日