基金管理人:金鹰基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年三月二十八日

金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金

2012年度报告摘要

2012年12月31日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之一以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	金鹰中证技术领先指数增强
基金主代码	210007
交易代码	210007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月1日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	99,895,855.26份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，跟踪指数为本基金的首要目标，力求实现对中证技术领先指数的有效跟踪；对于指数增强部分，采取适当的增强策略，力争取得超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金将在基金合同规定的投资范围内，采用"自上而下"的分析视角，综合考量中国宏观经济所处投资时钟的象限、国内股票市场的估值、国内债券市场收益率的期限结构、CPI与PPI变动趋势、外围主要经济体宏观经济与资本市场的运行状况等因素，分析研判股票市场、债券市场、货币市场的预期收益与风险，合理确定并适时动态地调整本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例，力争取得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率(税后)×10%。
风险收益特征	本基金为以跟踪指数为主，主动投资为辅的股票型证券投资基金，属于证券投资基金当中收益、风险较高的品种，一般情形下，其风险和预期收益高于混合型、债券型、货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	苏文锋	唐州徽
	联系电话	020-83282627	010-66594855
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgcxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4006135888,020-83936180	95566
传真		020-83282856	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区体育西路189号城建大厦22-23层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年	2011年6月1日至2011年12月31日	2010年
本期已实现收益	-16,465,296.00	-15,390,486.72	-
本期利润	-4,941,440.14	-35,283,937.35	-
加权平均基金份额本期利润	-0.0451	-0.1837	-
本期基金份额净值增长率	-6.30%	-25.03%	-
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2975	-0.2503	-
期末基金资产净值	70,180,520.54	98,297,793.98	-
期末基金份额净值	0.7025	0.7497	-

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;
2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实现收益水平要低于所列数字;
3.期末可供分配利润,指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数);
4.本基金合同于2011年6月1日生效,至本报告期末基金成立未满三年。

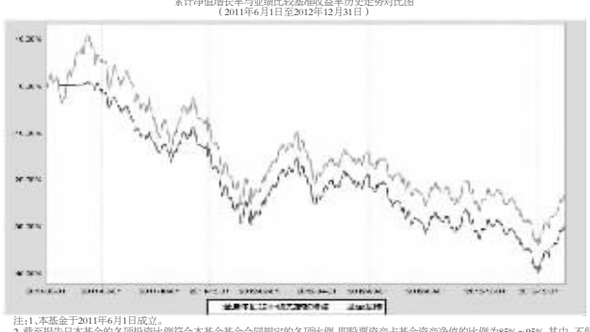
3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.06%	1.25%	1.35%	1.23%	-0.29%	0.02%
过去六个月	-6.53%	1.27%	-5.07%	1.26%	-1.46%	0.01%
过去一年	-6.30%	1.37%	-3.35%	1.36%	-2.95%	0.01%
自基金合同生效起至今	-29.75%	1.22%	-23.21%	1.37%	-6.54%	-0.15%

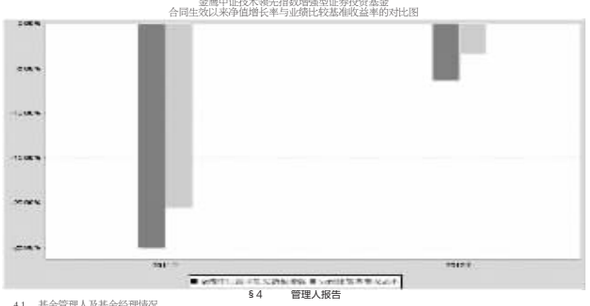
注:本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率(税后)×10%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金于2011年6月1日成立。
2.截至报告日本基金的各项投资比例符合本基金基金合同规定的各项比例,即股票资产占基金资产净值的比例为85%~95%,其中,不低于80%的基金净资产将投资于中证技术领先指数的成分股和备选成分股;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的5%~15%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证投资的比例范围占基金资产净值的0%~3%。
3.本基金业绩比较基准为中证技术领先指数×90%+活期存款利率(税后)×10%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

金鹰基金管理有限公司经中国证监会证监基字[2002]97号文批准,于2002年12月25日成立,是目律制度下中国证监会批准设立的首批基金管理公司之一,公司注册资本2.5亿元人民币,股东包括广州证券有限责任公司、广州药业股份有限公司、广东美的电器股份有限公司和东亚联丰投资管理有限公司,分别持有49%、20%、20%和11%的股份。

公司设立了投资决策委员会、风险控制委员会、资产估值委员会等专业委员会,投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险,并提出防范措施。资产估值委员会负责依照基金合同和基金估值制度的规定,确定基金资产估值的原则、方法、程序及其他相关的估值事宜。

公司目前下设十二个部门:总经理办公室、基金管理部、研究发展部、集中交易部、金融工程部、产品研发部、固定收益投资部、市场拓展部、机构客户部、专户投资部、运作保障部、监察稽核部、综合管理部。基金管理部负责根据投资决策委员会制定的投资决策进行基金投资;研究发展部负责宏观经济、行业、上市公司研究和投资策略研究;集中交易部负责完成基金经理投资指令;金融工程部负责金融工程研究、数量分析工作;产品研发部负责基金产品、新业务的研究和设计工作;固定收益投资部负责固定收益证券以及债券、货币市场的研究和投资管理工作;市场拓展部负责市场营销策划、基金销售与渠道管理、客户服务与分析、机构客户部负责机构客户的开发、维护与管理;运作保障部负责公司信息系统的日常运行与维护、跟踪研究新技术、进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务;专户投资部负责特定客户资产的投资和管理;监察稽核部负责对公司和基金运作以及公司员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查;综合管理部负责公司企业文化建设、文字档案、公司财务、后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等综合事务管理。

截至2012年12月31日,公司共管理金鹰成份股优选证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金、金鹰行业优势股票型证券投资基金、金鹰稳健成长股票型证券投资基金、金鹰主题优势股票型证券投资基金、金鹰保本混合型证券投资基金、金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金、金鹰策略配置股票型证券投资基金、金鹰持久回报分级债券型证券投资基金、金鹰核心资源股票型证券投资基金、金鹰中证500指数分级证券投资基金、金鹰元素精选信用债债券型证券投资基金和金鹰货币市场证券投资基金十四只开放式基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱丹	基金经理	2011-06-01	2012-08-01	6年	朱丹女士,金融学硕士,曾任职于深圳鼎基咨询公司,2007年6月加入金鹰基金管理有限公司,先后担任行业研究员、研究组长、基金经理助理等职,现任金鹰中小盘证券投资基金以及金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张永东	金融工程部总监、基金经理	2012-02-16	-	9年	张永东先生,工学博士,FRM(金融风险管理师),证券从业经历9年,中山大学数学与计算科学学院兼职研究生导师。曾任广发证券和中山大学联合博士后工作站研究人员、广发证券发展研究中心金融工程组负责人、华南理工大学副教授、硕士生导师以及广发基金、天治基金、益民基金金融工程负责人等职,2010年7月加入金鹰基金管理有限公司,现任金融工程部总监,本基金基金经理以及金鹰中证500指数分级证券投资基金基金经理。

注:1.任职日期和离任日期指公司公告聘任或解聘日期;
2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰中证技术领先指数增强型证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无出现重大违法违规或应反基金合同的行为,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本报告期,本基金管理人按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,根据本公司《公平交易制度》的规定,通过规范化的投资、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等;事中重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,必要时启用投资交易系统中的公平交易模块;事后加强对不同投资组合的交易价差、收益率的分析,以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期,本基金管理人按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求,根据本公司《公平交易制度》的规定,通过规范化的投资、研究和交易流程,确保公平对待不同投资组合,切实防范利益输送。

本基金管理人事前规定了严格的股票备选库管理制度、投资权限管理制度、债券库管理制度和集中交易制度等;事中重视交易执行环节的公平交易措施,以"时间优先、价格优先"作为执行指令的基本原则,必要时启用投资交易系统中的公平交易模块;事后加强对不同投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000503	海虹控股	58,900	558,372.00	0.80
2	000400	许继电气	22,100	544,765.00	0.78
3	601633	长城汽车	21,800	516,660.00	0.74
4	002294	信立泰	13,300	509,390.00	0.73
5	600557	康缘药业	23,900	497,120.00	0.71
6	002230	科大讯飞	16,200	490,860.00	0.70
7	300070	碧水源	12,100	485,210.00	0.69
8	000661	长春高新	7,900	482,690.00	0.69
9	300122	智飞生物	14,500	481,400.00	0.69
10	000625	长安汽车	70,300	467,495.00	0.67

8.3.2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002308	威创股份	27,300	272,727.00	0.39
2	600498	烽火通信	11,900	270,844.00	0.39
3	300105	龙源技术	11,124	244,394.28	0.35
4	601126	四方股份	15,822	224,514.18	0.32
5	300124	汇川技术	7,648	183,169.60	0.26

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002129	中环股份	2,338,912.83	2.38
2	002056	横店东磁	2,285,459.16	2.33
3	600072	中船股份	2,042,809.20	2.08
4	002594	比亚迪	2,040,016.42	2.08
5	600410	华胜天成	1,955,725.98	1.99
6	600460	士兰微	1,884,720.33	1.92
7	600435	北方导航	1,871,317.94	1.90
8	000823	超声电子	1,842,661.37	1.87
9	600252	中恒集团	1,840,739.54	1.87
10	002028	思源电气	1,801,987.50	1.83
11	002073	软控股份	1,797,326.63	1.83
12	600690	青岛海尔	1,784,930.71	1.82
13	002168	深圳惠程	1,772,335.95	1.80
14	000518	四环生物	1,769,437.19	1.80
15	601311	骆驼股份	1,763,542.75	1.79
16	000623	吉林敖东	1,749,926.00	1.78
17	000636	风华高科	1,736,452.88	1.77
18	002396	星网锐捷	1,726,237.22	1.76
19	600651	飞乐音响	1,703,796.29	1.73
20	600582	天地科技	1,692,871.00	1.72

8.4.2累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002129	中环股份	2,514,846.30	2.56
2	002056	横店东磁	2,425,234.34	2.47
3	600435	北方导航	2,280,702.88	2.32
4	600072	中船股份	2,194,550.47	2.23
5	000518	四环生物	2,126,680.89	2.16
6	600410	华胜天成	2,056,164.46	2.09
7	002396	星网锐捷	2,034,303.31	2.07
8	000823	超声电子	2,020,355.61	2.06
9	002376	新北洋	1,984,007.56	2.02
10	600436	片仔癀	1,980,949.51	2.02
11	002594	比亚迪	1,972,738.53	2.01
12	600067	冠城大通	1,964,484.40	2.00
13	002168	深圳惠程	1,940,782.80	1.97
14	600690	青岛海尔	1,880,916.58	1.91
15	002028	思源电气	1,868,265.66	1.90
16	000636	风华高科	1,846,670.98	1.88
17	600252	中恒集团	1,846,421.70	1.88
18	000623	吉林敖东	1,838,525.33	1.87
19	000423	东阿阿胶	1,832,902.07	1.86
20	002038	双鹭药业	1,824,116.25	1.86

8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	218,499,806.78
卖出股票的收入(成交)总额	234,697,324.99

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	24,561.60	0.03
8	其他	-	-
9	合计	24,561.60	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110022	同仁转债	210	24,561.60	0.03

注:本基金本报告期末仅持有一只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,909.23
2	应收证券清算款	1,601,022.67
3	应收股利	-
4	应收利息	1,109.56
5	应收申购款	37,061.31
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,642,102.77

8.9.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.5.2期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
2,378	42,008.35	6,022,745.69	6.03%	93,873,109.57	93.97%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	11,019.83	0.0110%

注:1.截至本报告期末,本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0。
2.截至本报告期末,本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2011年6月1日)基金份额总额	431,551,810.02
本报告期期初基金份额总额	131,108,302.99
本报告期期间基金总申购份额	10,066,820.18
减:本报告期期间基金总赎回份额	41,279,267.91
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	99,895,855.26

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2.2013年3月17日,根据国家金融工作需要,肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为立信会计师事务所(特殊普通合伙)。

本报告期内应支付会计师事务所的审计费为56000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广州证券	2	113,502,330.75	25.05%	94,970.70	25.29%	-
华泰联合	1	112,860,569.26	24.91%	91,700.08	24.42%	-
国信证券	1	63,099,946.76	13.93%	50,630.81	13.48%	-
国泰君安	1	52,910,767.89	11.68%	46,279.84	12.32%	-
中金公司	1	49,709,776.89	10.97%	42,252.98	11.25%	-
国元证券	1	20,827,124.19	4.60%	16,611.64	4.42%	-
华创证券	1	20,662,538.63	4.56%	17,260.48	4.60%	-
国金证券	1	5,698,964.93	1.26%	4,730.17	1.26%	-
招商证券	1	4,789,642.45	1.06%	3,891.70	1.04%	-
世纪证券	1	2,924,153.10	0.65%	2,342.83	0.62%	-
平安证券	1	2,664,856.52	0.59%	2,165.24	0.58%	-
安信证券	1	2,178,902.91	0.48%	1,709.09	0.46%	-
光大证券	1	1,106,419.09	0.24%	873.78	0.23%	-
英大证券	1	191,683.00	0.04%	153.55	0.04%	-

注:本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基字[1998]29号)的有关规定要求及金鹰行业优势证券投资基金基金合同规定的选择券商的标准、选择券商程用其席位。本基金管理人负责选择证券经营机构,租用其交易单元作为本基金的专用交易单元。本基金专用交易单元的选择标准如下:

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下:

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广州证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	41,700,000.00	14.64%	-	-
国泰君安	-	-	178,000,000.00	62.48%	-	-
中金公司	-	-	40,900,000.00	14.36%	-	-
国元证券	-	-	7,600,000.00	2.67%	-	-
华创证券	-	-	10,200,000.00	3.58%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	3,000,000.00	1.05%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	3,500,000.00	1.23%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1.公司成立深圳分公司

经公司董事会决议通过,并经中国证券监督管理委员会深圳监管局《关于核准金鹰基金管理有限公司设立深圳分公司的批复》(深证局发〔2012〕117号)批复同意,我公司向深圳市市场监管局申请登记设立深圳分公司,分公司负责人为郭容辰,营业场所位于深圳市福田中心区中国风属大厦2栋17G,经营范围是基金销售及公司授权的其他业务。目前相关工商登记注册手续已办理完毕。公司已于2012年7月11日对此事项进行了公开披露。

金鹰基金管理有限公司
二〇一三年三月二十八日