

運用報告書（全体版）

第21期

（決算日：2023年5月29日）

当ファンドの仕組みは、次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間とクローズド期間	原則として無期限（クローズド期間はありませぬ）	
運 用 方 針	主としてSBI TOPIX100・インデックス マザーファンドに投資し、TOPIX100・インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要運用対象	当ファンド（ベビーファンド）	SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、株式等に直接投資することもあります。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、TOPIX100・インデックスに採用されている銘柄を主要投資対象とします。
組 入 制 限	当ファンド（ベビーファンド）	株式への実質投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。
分 配 方 針	毎決算時に、基準価額水準及び市場動向等を勘案して分配を行います。ただし、分配対象額が少額の場合等、委託会社の判断により収益分配を行わないこともあります。	

 SBI Asset Management

SBI TOPIX100・ インデックスファンド ＜DC年金＞

追加型投信／国内／株式／インデックス型

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。さて、「SBI TOPIX100・インデックスファンド＜DC年金＞」は、2023年5月29日に第21期決算を行いました。

ここに期中の運用状況をご報告申し上げます。今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

SBIアセットマネジメント株式会社

東京都港区六本木1-6-1

お問い合わせ先

電話番号 03-6229-0097

受付時間：営業日の9：00～17：00

ホームページから、ファンドの商品概要、レポート等をご覧いただけます。

<http://www.sbiasset.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		株式組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
17期(2019年5月27日)	12,831	0	△ 7.7	994.96	△ 9.9	96.8	6,108
18期(2020年5月27日)	13,068	0	1.8	991.13	△ 0.4	96.9	6,676
19期(2021年5月27日)	16,784	0	28.4	1,248.90	26.0	97.9	8,899
20期(2022年5月27日)	17,271	0	2.9	1,258.06	0.7	98.0	9,908
21期(2023年5月29日)	20,246	0	17.2	1,442.33	14.6	98.2	12,098

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注3) ベンチマークは TOPIX100・インデックスです。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2022年5月27日	17,271	—	1,258.06	—	98.0
5月末	17,522	1.5	1,276.78	1.5	98.0
6月末	17,001	△ 1.6	1,236.94	△ 1.7	98.5
7月末	17,655	2.2	1,284.95	2.1	99.3
8月末	17,787	3.0	1,294.61	2.9	99.4
9月末	16,710	△ 3.2	1,202.44	△ 4.4	98.2
10月末	17,728	2.6	1,277.24	1.5	98.5
11月末	18,261	5.7	1,316.14	4.6	98.5
12月末	17,368	0.6	1,249.46	△ 0.7	99.0
2023年1月末	18,225	5.5	1,311.89	4.3	99.5
2月末	18,336	6.2	1,319.90	4.9	99.6
3月末	18,660	8.0	1,327.83	5.5	98.2
4月末	19,111	10.7	1,360.81	8.2	98.5
(期末)					
2023年5月29日	20,246	17.2	1,442.33	14.6	98.2

(注1) 騰落率は期首比。

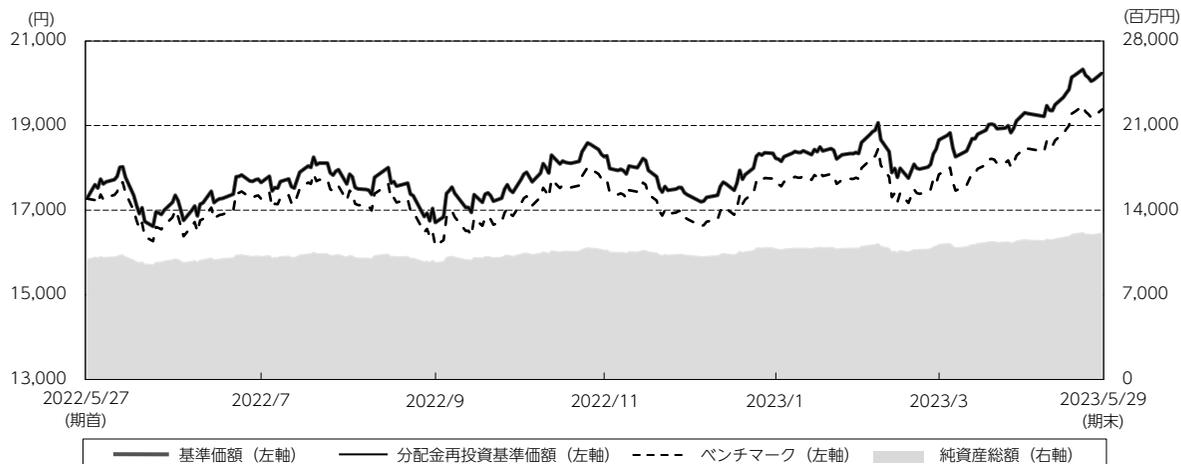
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注3) ベンチマークは TOPIX100・インデックスです。

TOPIX100・インデックスは、東京証券取引所の株価指数「TOPIX」の構成銘柄を一定の基準で規模ごとに細分化した時価総額加重型株価指数の一つです。TOPIX100 構成銘柄は、TOPIX の構成銘柄の中から、時価総額及び流動性の高い100 銘柄で構成される大型株指数のことをいいます。なお、TOPIX100 に関する著作権、知的財産権その他一切の権利は株式会社 JPX 総研又は株式会社 JPX 総研の関連会社に帰属します。

■当期の運用状況と今後の運用方針（2022年5月28日から2023年5月29日まで）

○基準価額等の推移



(注1) 分配金再投資基準価額は、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注2) 分配金の再投資についてはお客様がご利用のコース等により異なります。また、ファンドの運用経過については、当ファンドのパフォーマンスを示したものであり、ファンドの購入価額により課税条件等が異なるため、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、期首（2022年5月27日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注4) ベンチマークはTOPIX100・インデックスです。詳細はP1をご参照ください。

○基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ・米消費者物価指数（CPI）の伸び鈍化による米国金融政策の緩和への期待
- ・新型コロナウイルス感染拡大防止のために実施されていた中国の行動制限緩和への期待
- ・原油高一服に伴ってリスク回避の動きが後退したこと
- ・良好な米国大型ハイテク企業や一部の国内企業の決算
- ・国内株式に対し、海外投資家からの買いが強まったこと

下落要因

- ・米連邦準備制度理事会（FRB）の積極的な政策金利引上げ
- ・中国景気の低迷による世界的な需要不足への懸念
- ・英減税計画により英財政悪化が懸念されリスク回避が強まったこと
- ・日本銀行の金融政策決定会合において、長期金利の許容変動幅が拡大されたこと
- ・米銀行破綻により信用不安が強まったこと

○投資環境

当期の東証株価指数（TOPIX）は1,900円近辺から始まりました。6月は米消費者物価指数（CPI）の上ぶれから米連邦準備制度理事会（FRB）が大幅利上げを決定する中、世界的に株安となりTOPIXも下落しました。

大型ハイテク企業の好決算などによる米国株高が支えとなり8月中旬ごろにTOPIXは2,000円台まで上昇したものの、FRBの大幅利上げや英減税計画による英財政悪化への懸念に伴う金利急騰などから、世界的にリスク回避の動きが強まり9月は下落しました。その後、米CPIの伸び鈍化などにより米国株が上昇したことにつれ、TOPIXは上昇局面に入りました。しかしながら、12月は日本銀行が金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を拡大したことでTOPIXが下落しました。1月は日本銀行が現行の金融政策を維持するとともに、金利上昇の抑制を図る措置を決定したことから、国内株の下押し圧力が弱まり、円安もありTOPIXが上昇しました。3月中旬、米銀行破綻懸念を受けてTOPIXが軟調となりました。しかし、米当局の迅速な対応により信用不安が後退し、3月は月間でTOPIXが上昇しました。4月は堅調な米雇用統計から米景気減速懸念が和らぐ中、米著名投資家が日本株への追加投資を示唆したことや、国内小売大手の決算などが好感され、TOPIXが上昇しました。その後、海外投資家からの買いが強まるとともに、円安進行もあってTOPIXが一段と上昇しました。通期ではTOPIXが上昇し、2,100円台で終わりました。

○当ファンドのポートフォリオ

<当ファンド>

ベンチマークであるTOPIX100・インデックスに連動する投資成果をめざし、「SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド」受益証券を高位に組入れて運用を行いました。

<SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド>

ベンチマークであるTOPIX100・インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいりました。インデックスとの乖離を最小限に抑えるべくトラッキングエラーやリスクを管理し、組入比率を高位に維持することなどにより、ほぼベンチマークに近い運用を行いました。

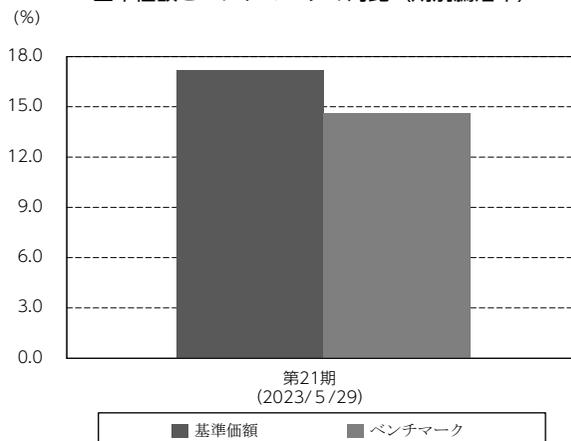
また、株式の組入比率に関しては、97%以上の株式組入比率を維持しました。なお、期末の株式組入比率は98.1%となっております。

○当ファンドのベンチマークとの差異

期中における基準価額は、+17.2%の値上がりとなり、ベンチマークである TOPIX100・インデックスの騰落率+14.6%を概ね2.6%上回りました。

株式配当金の受取りがプラスに寄与した一方で、売買手数料などの諸費用を支払ったことがマイナスに寄与しました。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



- (注1) 基準価額の騰落率は分配金（税引き前）込みです。
 (注2) ベンチマークは、TOPIX100・インデックスです。詳細はP1をご参照ください。

○分配金

当期の収益分配は、運用の効率性と基準価額の水準を勘案し見送ることといたしました。

なお、収益分配にあてなかった利益につきましては、信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項目	第21期
	2022年5月28日～ 2023年5月29日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	15,825

- (注1) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
 (注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

<当ファンド>

引き続き「SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド」受益証券に投資する方針です。また、現金比率を極力抑え連動率を高めていく所存です。

<SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド>

引き続きわが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX100・インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 5 月28日～2023年 5 月29日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社)	円 47 (18) (20) (10)	% 0.265 (0.100) (0.111) (0.055)	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 委託した資金の運用の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	1 (1)	0.007 (0.007)	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権 口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に 支払う手数料
(c) そ の 他 費 用 (監 査 費 用) (そ の 他)	1 (1) (0)	0.007 (0.006) (0.001)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	49	0.279	
期中の平均基準価額は、17,863円です。			

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

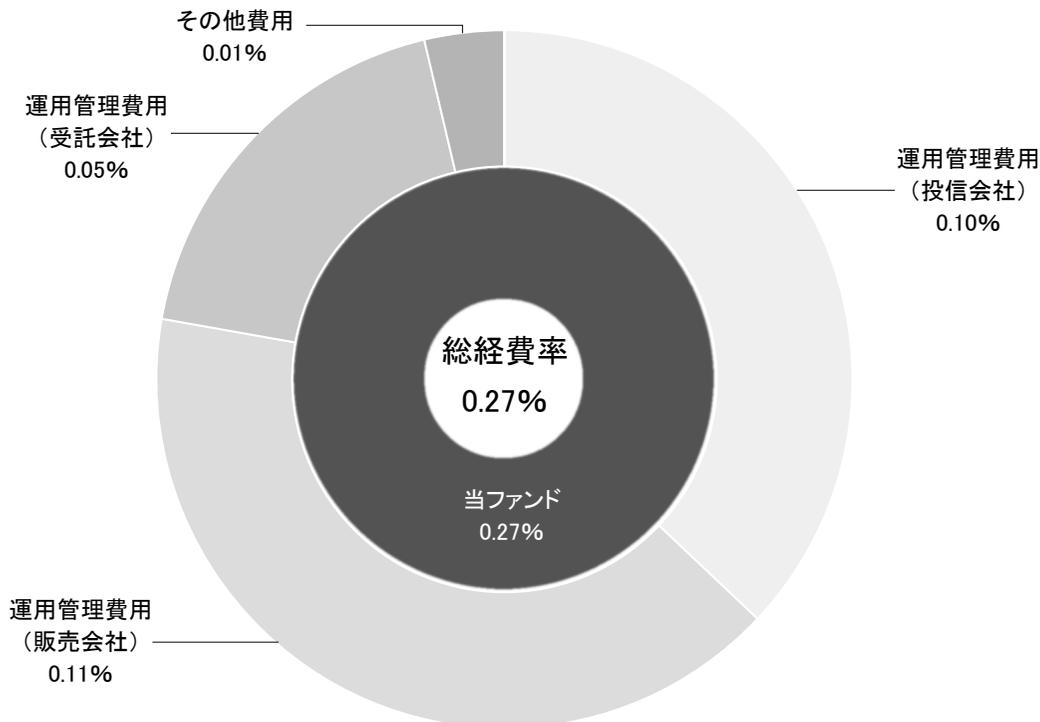
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注5) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率(年率)**は**0.27%**です。



(注1) 上記費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。なお、四捨五入の関係により、合計が一致しない場合があります。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年5月28日～2023年5月29日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド	千口 655,573	千円 1,392,010	千口 454,240	千円 982,070

(注) 単位未満は切捨て。

○株式売買比率

(2022年5月28日～2023年5月29日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期
	SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,117,634千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,322,991千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年5月28日～2023年5月29日)

利害関係人との取引状況

<SBI TOPIX100・インデックスファンド<DC年金>>

該当事項はありません。

<SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド>

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 1,380	百万円 1,089	% 78.9	百万円 736	百万円 471	% 64.0

平均保有割合 100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該子ファンドの親投資信託所有口数の割合。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当期
売買委託手数料総額 (A)	734千円
うち利害関係人への支払額 (B)	685千円
(B) / (A)	93.3%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは株式会社SBI証券です。

○組入資産の明細

(2023年5月29日現在)

親投資信託残高

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド	千口	千口	千円
	4,888,750	5,090,083	12,113,379

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年5月29日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド	千円	%
	12,113,379	99.8
コール・ローン等、その他	22,621	0.2
投資信託財産総額	12,136,000	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○特定資産の価格等の調査

該当事項はありません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月29日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	12,136,000,206円
コール・ローン等	20,640
SEI TOPIX100・インデックス マザーファンド(評価額)	12,113,379,566
未収入金	22,600,000
(B) 負債	37,340,589
未払解約金	22,584,145
未払信託報酬	14,371,444
その他未払費用	385,000
(C) 純資産総額(A-B)	12,098,659,617
元本	5,975,736,706
次期繰越損益金	6,122,922,911
(D) 受益権総口数	5,975,736,706口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,246円

<注記事項 (運用報告書作成時には監査未了) >

(貸借対照表関係)

期首元本額	5,736,988,793円
期中追加設定元本額	1,226,421,181円
期中一部解約元本額	987,673,268円

○損益の状況 (2022年5月28日～2023年5月29日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 31,051円
支払利息	△ 31,051
(B) 有価証券売買損益	1,719,968,230
売買益	1,815,246,417
売買損	△ 95,278,187
(C) 信託報酬等	△ 28,699,054
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,691,238,125
(E) 前期繰越損益金	1,617,647,217
(F) 追加信託差損益金	2,814,037,569
(配当等相当額)	(6,142,236,802)
(売買損益相当額)	(△ 3,328,199,233)
(G) 計(D+E+F)	6,122,922,911
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	6,122,922,911
追加信託差損益金	2,814,037,569
(配当等相当額)	(6,147,991,697)
(売買損益相当額)	(△ 3,333,954,128)
分配準備積立金	3,308,885,342

(注1) 損益の状況の中で**(B)有価証券売買損益**は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で**(C)信託報酬等**には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) 損益の状況の中で**(F)追加信託差損益金**とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(274,256,984円)、費用控除後の有価証券等損益額(1,409,624,110円)、信託約款に規定する収益調整金(6,147,991,697円)および分配準備積立金(1,625,004,248円)より分配対象収益は9,456,877,039円(10,000口当たり15,825円)ですが、当期に分配した金額はありません。

第21期 運用報告書

(決算日 2023年5月29日)

SBI TOPIX100・インデックス マザーファンド

受益者のみなさまへ

SBI TOPIX100・インデックス マザーファンドの第21期（2022年5月28日から2023年5月29日まで）の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは、次の通りです。

運用方針	TOPIX100・インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要運用対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち、TOPIX100・インデックスに採用されている銘柄を主要投資対象とします。
組入制限	株式への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率	純資産総額
		期中騰落率		期中騰落率		
	円	%		%	%	百万円
17期(2019年5月27日)	14,912	△ 7.5	994.96	△ 9.9	97.0	6,093
18期(2020年5月27日)	15,228	2.1	991.13	△ 0.4	97.2	6,660
19期(2021年5月27日)	19,621	28.8	1,248.90	26.0	98.1	8,884
20期(2022年5月27日)	20,245	3.2	1,258.06	0.7	98.1	9,897
21期(2023年5月29日)	23,798	17.6	1,442.33	14.6	98.1	12,113

(注1) ベンチマークは TOPIX100・インデックスです。

(注2) 株式組入比率は純資産総額に対する評価額の比率です。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		株式組入比率
		騰落率		騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2022年5月27日	20,245	—	1,258.06	—	98.1
5月末	20,541	1.5	1,276.78	1.5	98.1
6月末	19,934	△ 1.5	1,236.94	△ 1.7	98.6
7月末	20,706	2.3	1,284.95	2.1	99.4
8月末	20,866	3.1	1,294.61	2.9	99.5
9月末	19,606	△ 3.2	1,202.44	△ 4.4	98.3
10月末	20,807	2.8	1,277.24	1.5	98.6
11月末	21,437	5.9	1,316.14	4.6	98.6
12月末	20,392	0.7	1,249.46	△ 0.7	99.1
2023年1月末	21,404	5.7	1,311.89	4.3	99.6
2月末	21,539	6.4	1,319.90	4.9	99.7
3月末	21,924	8.3	1,327.83	5.5	98.3
4月末	22,459	10.9	1,360.81	8.2	98.6
(期末)					
2023年5月29日	23,798	17.6	1,442.33	14.6	98.1

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 未払金等がある場合は、株式組入比率が100%を超えることがあります。

(注3) ベンチマークは TOPIX100・インデックスです。

(注4) 株式組入比率は純資産総額に対する評価額の比率です。

■当期の運用状況と今後の運用方針（2022年5月28日から2023年5月29日まで）

○基準価額等の推移

【基準価額及びベンチマークの推移】



(注1) ベンチマークは TOPIX100・インデックスです。詳細は P1 をご参照ください。

(注2) ベンチマークは期首（2022年5月27日）の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

当ファンドのマザーファンドの基準価額は期首 20,245 円から始まったあと、期末には 23,798 円となりました。期を通じて騰落率は+17.6%となりました。

	期首	期中高値	期中安値	期末
日付	2022/5/27	2023/5/22	2022/6/20	2023/5/29
基準価額 (円)	20,245	23,894	19,485	23,798

○投資環境

当期の東証株価指数（TOPIX）は1,900円近辺から始まりました。6月は米消費者物価指数（CPI）の上ぶれから米連邦準備制度理事会（FRB）が大幅利上げを決定する中、世界的に株安となりTOPIXも下落しました。

大型ハイテク企業の好決算などによる米国株高が支えとなり8月中旬ごろにTOPIXは2,000円台まで上昇したものの、FRBの大幅利上げや英減税計画による英財政悪化への懸念に伴う金利急騰などから、世界的にリスク回避の動きが強まり9月は下落しました。その後、米CPIの伸び鈍化などにより米国株が上昇したことにつれ、TOPIXは上昇局面に入りました。しかしながら、12月は日本銀行が金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を拡大したことでTOPIXが下落しました。1月は日本銀行が現行の金融政策を維持するとともに、金利上昇の抑制を図る措置を決定したこと、国内株の下押し圧力が弱まり、円安もありTOPIXが上昇しました。3月中旬、米銀行破綻懸念を受けてTOPIXが軟調となりました。しかし、米当局の迅速な対応により信用不安が後退し、3月は月間でTOPIXが上昇しました。4月は堅調な米雇用統計から米景気減速懸念が和らぐ中、米著名投資家が日本株への追加投資を示唆したことや、国内小売大手の決算などが好感され、TOPIXが上昇しました。その後、海外投資家からの買いが強まるとともに、円安進行もあってTOPIXが一段と上昇しました。通期ではTOPIXが上昇し、2,100円台で終わりました。

○当ファンドのポートフォリオ

ベンチマークであるTOPIX100・インデックスの動きに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいりました。インデックスとの乖離を最小限に抑えるべくトラッキングエラーやリスクを管理し、組入比率を高位に維持することなどにより、ほぼベンチマークに近い運用を行いました。

また、株式の組入比率に関しては、97%以上の株式組入比率を維持しました。なお、期末の株式組入比率は98.1%となっております。

○当ファンドのベンチマークとの差異

期中における基準価額は、+17.6%の値上がりとなり、ベンチマークであるTOPIX100・インデックスの騰落率+14.6%をおおむね3.0%上回りました。

株式配当金の受取りがプラスに寄与しました。一方、売買手数料などの諸費用を支払ったことがマイナスに寄与しました。

○今後の運用方針

引き続きわが国の株式を中心に投資を行い、TOPIX100・インデックスと連動する投資成果を目標として運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年 5 月 28 日～2023年 5 月 29 日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売買委託手数料 (株 式)	円 1 (1)	% 0.007 (0.007)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他費用
合 計	1	0.007	
期中の平均基準価額は、20,967円です。			

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○ 売買及び取引の状況

(2022年 5 月 28 日～2023年 5 月 29 日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株	千円	千株	千円
		486	1,380,986	267	736,648
		(180)	(-)		

(注1) 金額は受け渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

○株式売買比率

(2022年5月28日～2023年5月29日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	2,117,634千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,322,991千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.20

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2022年5月28日～2023年5月29日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 1,380	百万円 1,089	% 78.9	百万円 736	百万円 471	% 64.0

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	734千円
うち利害関係人への支払額 (B)	685千円
(B) / (A)	93.3%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドに係る利害関係人とは株式会社SBI証券です。

○組入資産の明細

(2023年5月29日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
建設業 (0.9%)			
大和ハウス工業	16.8	16.6	59,643
積水ハウス	19.9	18.6	52,712
食料品 (2.8%)			
アサヒグループホールディングス	13.7	13.8	73,885
キリンホールディングス	22.5	26.9	56,073
味の素	12.9	14.4	78,393
日本たばこ産業	32.8	39.2	120,853
繊維製品 (0.3%)			
東レ	41.2	40.6	29,865
化学 (5.2%)			
旭化成	38.7	37.8	36,495
信越化学工業	10	50.3	221,470
三菱ケミカルグループ	38.9	40.9	33,775
花王	13.2	14.7	74,676
富士フイルムホールディングス	10.7	11.6	98,936
資生堂	11.4	12.7	82,588
ユニ・チャーム	11.7	12.6	65,230
医薬品 (7.6%)			
武田薬品工業	47.9	53.7	243,744
アステラス製薬	52.1	57.3	131,560
塩野義製薬	7.5	7.6	46,960
中外製薬	19.1	19	72,314
エーザイ	7.1	7.4	66,045
小野薬品工業	13.3	11.7	30,420
第一三共	46.7	52.8	239,923
大塚ホールディングス	12.3	13.9	72,669
石油・石炭製品 (0.4%)			
ENEOSホールディングス	91.7	102.9	49,031
ゴム製品 (0.9%)			
ブリヂストン	17.1	19.4	111,802
鉄鋼 (0.7%)			
日本製鉄	26.4	27.9	78,426

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
非鉄金属 (0.6%)			
住友金属鉱山	7.3	7.2	31,140
住友電気工業	22	21.5	36,679
機械 (4.8%)			
SMC	1.8	2	149,100
小松製作所	27.6	28.6	98,241
クボタ	29.5	32.3	64,600
ダイキン工業	7.4	7.3	195,275
マキタ	7.2	—	—
三菱重工業	9.4	10.7	65,633
電気機器 (22.7%)			
日立製作所	29.3	29.7	241,431
東芝	10.6	11.8	52,958
三菱電機	59.6	63.1	115,599
ニデック	15	14.9	105,715
オムロン	5.1	5.6	47,717
富士通	5.5	6.1	109,861
ルネサスエレクトロニクス	—	39.8	89,171
パナソニック ホールディングス	65	72.1	104,725
ソニーグループ	38.2	42.8	568,170
キーエンス	5.5	6	411,900
シスメックス	4.9	5.2	47,824
レーザーテック	2.6	2.8	62,762
ファナック	5.3	29.7	141,372
京セラ	8.6	9.4	72,079
村田製作所	17.5	18.3	151,103
キヤノン	30.3	33.2	116,465
東京エレクトロン	3.9	12.8	252,416
輸送用機器 (9.6%)			
デンソー	12.9	12.5	109,725
日産自動車	71.9	85.9	45,088
トヨタ自動車	298.4	332	640,262
本田技研工業	46.8	49.1	197,627

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千株	千円
スズキ	13.3	11.1	50,782	
SUBARU	17	19.1	45,878	
シマノ	2.4	2.5	54,375	
精密機器(3.2%)				
テルモ	17.2	18.6	78,547	
オリンパス	31.1	37.2	80,240	
HOYA	11.9	12.9	221,428	
その他製品(2.4%)				
バンダイナムコホールディングス	5.3	16.6	54,896	
任天堂	3.4	38.2	225,723	
陸運業(1.7%)				
東日本旅客鉄道	10.2	10.3	81,019	
西日本旅客鉄道	7.1	7.7	45,892	
東海旅客鉄道	4.8	4.7	79,900	
海運業(0.4%)				
日本郵船	—	16.1	48,525	
空運業(0.4%)				
ANAホールディングス	14.4	16.4	50,610	
情報・通信業(7.3%)				
Zホールディングス	86.2	86.3	30,187	
日本電信電話	64	77.7	316,161	
KDDI	43.6	46.9	204,343	
ソフトバンク	90.6	97.4	147,122	
ソフトバンクグループ	35.9	29.9	165,705	
卸売業(7.2%)				
伊藤忠商事	40	39.4	194,833	
丸紅	57	49.9	105,214	
三井物産	45.6	45.4	210,429	
住友商事	37.1	39.6	109,157	
三菱商事	43.1	39.6	233,956	
小売業(2.8%)				
セブン&アイ・ホールディングス	22.4	22	135,300	
イオン	22	21.7	61,649	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千株	千円
ニトリホールディングス	2.4	2.6	45,448	
ファーストリテイリング	0.8	2.9	95,845	
銀行業(7.3%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	368.5	372.9	346,051	
りそなホールディングス	66.6	75.3	47,807	
三井住友トラスト・ホールディングス	10.9	10.8	54,270	
三井住友フィナンシャルグループ	40.7	43.5	245,731	
みずほフィナンシャルグループ	75.3	86.1	178,657	
証券・商品先物取引業(0.5%)				
大和証券グループ本社	43.9	—	—	
野村ホールディングス	91.8	109.7	54,729	
保険業(3.1%)				
SOMPOホールディングス	9.4	10.2	59,782	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	13.1	12.1	58,503	
第一生命ホールディングス	28	29.1	71,265	
東京海上ホールディングス	18.4	58.9	183,237	
その他金融業(1.1%)				
オリックス	35.7	39.1	93,449	
日本取引所グループ	14.7	16.7	37,892	
不動産業(1.4%)				
三井不動産	26	25.7	69,582	
三菱地所	37.7	35.9	57,960	
住友不動産	12	10.8	35,640	
サービス業(4.7%)				
エムスリー	10.3	12.3	37,847	
オリエンタルランド	6.7	32.9	176,837	
リクルートホールディングス	43.9	46	204,240	
日本郵政	72.9	81.5	81,410	
セコム	5.7	6.3	58,445	
合計	株数・金額	3,245	3,645	11,878,657
	銘柄数<比率>	100	100	<98.1%>

(注1) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2) 合計欄の〈 〉内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。
(注4) 株数が単位未満の場合は小数で記載。

○投資信託財産の構成

(2023年5月29日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	11,878,657 千円	97.9 %
コール・ローン等、その他	257,388	2.1
投資信託財産総額	12,136,045	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

○特定資産の価格等の調査

該当事項はありません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月29日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	12,136,045,788円
コール・ローン等	134,196,752
株式(評価額)	11,878,657,780
未取配当金	123,191,256
(B) 負債	22,600,367
未払解約金	22,600,000
未払利息	367
(C) 純資産総額(A - B)	12,113,445,421
元本	5,090,083,018
次期繰越損益金	7,023,362,403
(D) 受益権総口数	5,090,083,018口
1万口当たり基準価額(C/D)	23,798円

<注記事項>

(貸借対照表関係)

期首元本額	4,888,750,763円
期中追加設定元本額	655,573,050円
期中一部解約元本額	454,240,795円
期末における元本の内訳	
SBI TOPIX100・インデックスファンド(DC年金)	5,090,083,018円

○損益の状況 (2022年5月28日～2023年5月29日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	278,943,022円
受取配当金	278,950,500
その他収益金	59,782
支払利息	△ 67,260
(B) 有価証券売買損益	1,527,194,716
売買益	1,733,673,583
売買損	△ 206,478,867
(C) その他費用	△ 378
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,806,137,360
(E) 前期繰越損益金	5,008,617,298
(F) 追加信託差損益金	736,436,950
(G) 解約差損益金	△ 527,829,205
(H) 計(D + E + F + G)	7,023,362,403
次期繰越損益金(H)	7,023,362,403

(注1) 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 損益の状況の中で(G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。