

# 運用報告書（全体版）

第20期

（決算日：2022年5月27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ん）	
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、2022年5月27日に第20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)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率		
	円	円	%		%	%	百万円
16期(2018年5月28日)	13,904	0	13.1	1,104.79	11.3	97.7	5,968
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

(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おります。

(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	%		%	%
2021年5月27日	16,784	—	1,248.90	—	97.9
5月末	16,904	0.7	1,273.84	2.0	98.3
6月末	17,048	1.6	1,268.04	1.5	98.8
7月末	16,671	△ 0.7	1,239.85	△ 0.7	99.0
8月末	17,183	2.4	1,278.21	2.3	99.3
9月末	18,023	7.4	1,329.67	6.5	98.2
10月末	17,793	6.0	1,312.33	5.1	98.5
11月末	17,352	3.4	1,278.86	2.4	98.6
12月末	17,993	7.2	1,325.68	6.1	99.5
2022年1月末	17,230	2.7	1,269.13	1.6	99.2
2月末	16,928	0.9	1,246.53	△ 0.2	99.1
3月末	17,844	6.3	1,300.84	4.2	98.2
4月末	17,399	3.7	1,268.00	1.5	98.1
(期末)					
2022年5月27日	17,271	2.9	1,258.06	0.7	98.0

(注1) 騰落率は期首比。

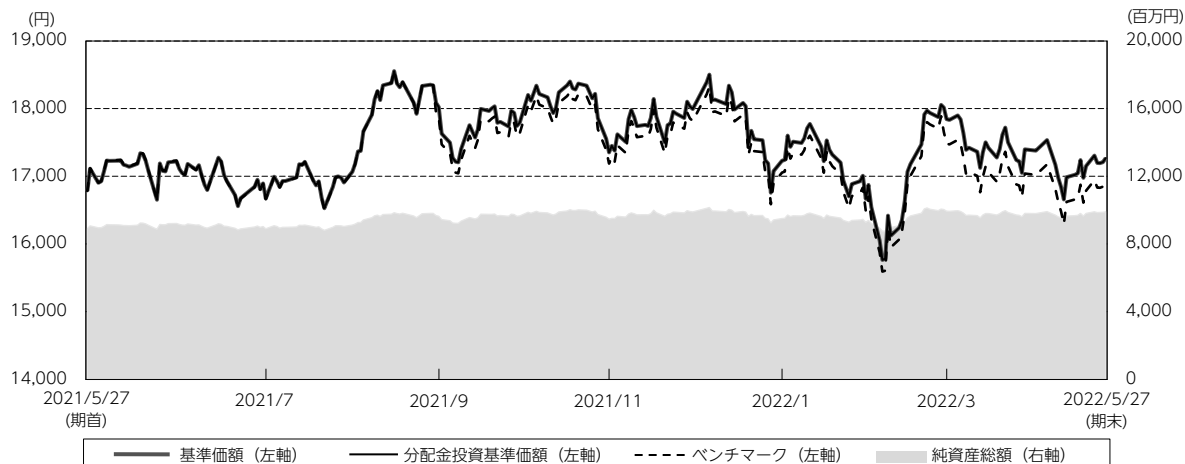
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しております。

(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6つに細分化した時価総額加重型株価指数の一つです。TOPIX100の構成銘柄は、上場後6カ月以上経過した東証市場第一部銘柄の中から、時価総額及び流動性の高い100銘柄で構成されています。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JPK総研又は株式会社JPK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（2021年5月28日から2022年5月27日まで）

### ○基準価額等の推移



期 首：16,784円

期 末：17,271円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率： 2.9%（分配金再投資ベース）

(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（2021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おります。

(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

当期、当ファンドは概ねTOPIX100指数に連動する値動きとなりました。期初、基準価額は16,784円から始まった後、菅首相（当時）の退陣表明をきっかけとした日本株急伸の流れを受け、2021年9月14日に期中最高値となる18,556円を付けました。年明け以降は、FRB（米連邦準備制度理事会）による積極的な金融引き締め策への警戒が強まった結果、グローバル株式市場がリスクオフの展開となりました。特に中小型株が軟調になり、当ファンドは、2022年3月8日に期中最安値となる15,766円を付けました。期末にかけては日本株の相対的な割安感を意識した買いが入ったこと等から戻りを試す展開となり、決算日である5月27日の基準価額は17,271円となりました。

## ○投資環境

---

当期のTOPIXは、1,000ポイント近辺でスタートした後、新型コロナ感染の再拡大とワクチン接種の遅れなどから横ばい圏での推移となりました。9月に入ると菅首相（当時）の退陣表明をきっかけに急反発を見せ、同月中旬には2,100ポイントを回復しましたが、自民党総裁選で岸田氏の選出が決まると、成長・改革への期待感が後退し、TOPIXは1,900～2,050ポイントでのボックス相場に移行しました。年明け以降は、1月5日に公表された12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）議事要旨の内容が市場の想定以上にタカ派であったことを受け、米国金利が急伸。金利上昇局面で軟調となりやすい高バリュエーション銘柄を中心に強い売り圧力に押された結果、1月下旬に1,850ポイント近辺まで下落しました。その後、売られすぎの反動や日米企業の良好な決算発表などを受けて戻りを試す展開となりましたが、ロシアによるウクライナ侵攻と、それを受けた各国の制裁発動への警戒感から再び売りに押される展開となり1,750ポイント近辺まで下落しました。また、資源価格の高騰を受け、物価上昇が各国の景気を冷やすとの懸念が高まったことも投資家心理を冷やす要因となりました。その後、原油高に一服感が見られたこと等から一時戻りを試す展開となりましたが、その動きは長続きせず、当期末のTOPIXは、1,800ポイント後半で取引を終えました。

## ○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。

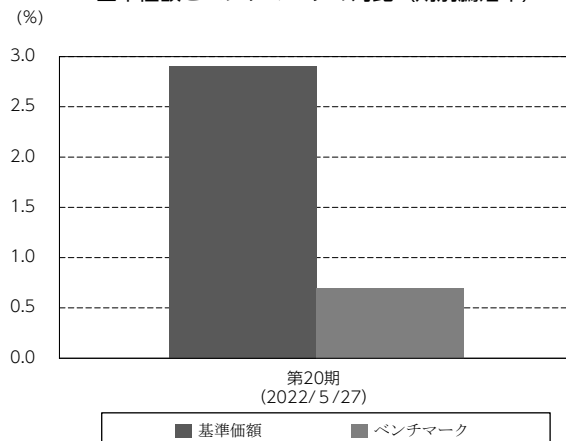
また、株式の組入比率に関しては、97%以上の株式組入比率を維持しました。なお、期末の株式組入比率は98.1%となっております。

## ○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、+2.9%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+0.7%をおおむね2.2%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。

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（税込み）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20期
	2021年5月28日～ 2022年5月27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	12,997

(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

(2021年5月28日～2022年5月27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 )	46 ( 17 ) ( 19 )  ( 10 )	0.264 (0.099) (0.110)  (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 )	2  ( 2 )	0.010  (0.010)	(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 ( 0 ) ( 0 )	0.004 (0.002) (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	0.278	
期中の平均基準価額は、17,364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。

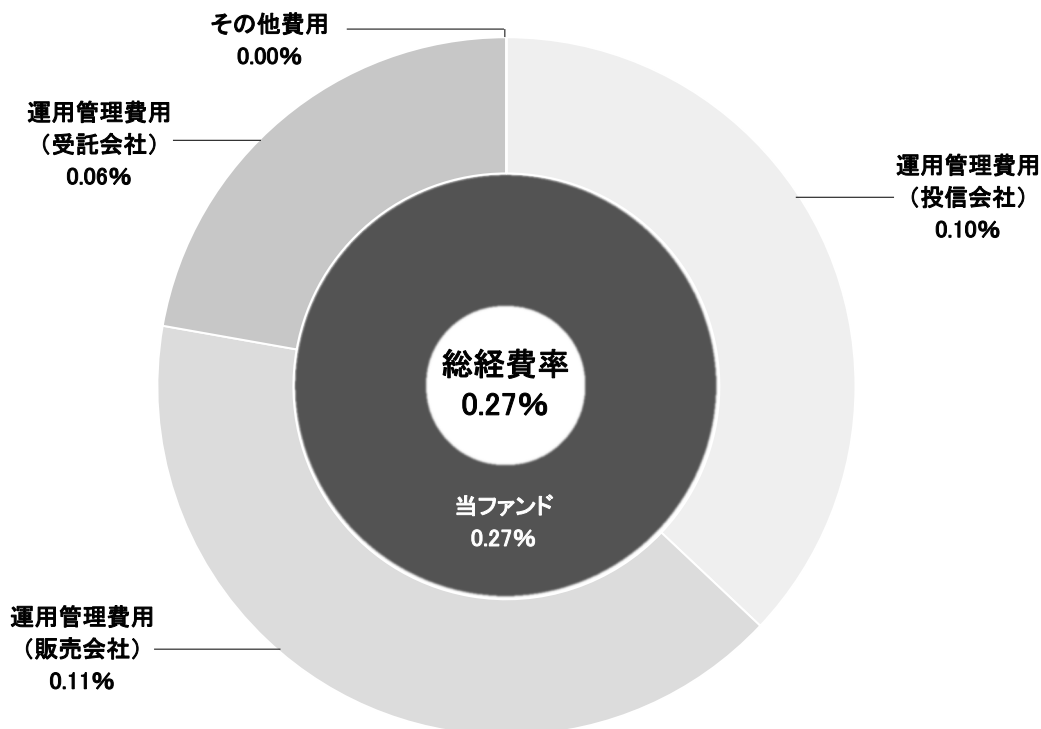
(注4) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2021年5月28日～2022年5月27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 725,665	千円 1,479,000	千口 364,970	千円 748,000

(注) 単位未満は切捨て。

## ○株式売買比率

(2021年5月28日～2022年5月27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	2,088,548千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,338,461千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.22	

(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

(2021年5月28日～2022年5月27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 1,513	百万円 1,513	% 100.0	百万円 574	百万円 574	% 100.0

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)	917千円
うち利害関係人への支払額 (B)	917千円
(B) / (A)	100.0%

(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

(2022年5月27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 4,528,055	千口 4,888,750	千円 9,897,275

(注) 口数・評価額の単位未満は切捨て。

### ○投資信託財産の構成

(2022年5月27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 9,897,275	% 99.7
コール・ローン等、その他	30,518	0.3
投資信託財産総額	9,927,793	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 (2022年5月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,927,793,702円
コール・ローン等	30,517,783
SEI TOPIX100・インデックス マザーファンド(評価額)	9,897,275,919
(B) 負債	19,714,229
未払解約金	6,993,006
未払信託報酬	12,555,792
未払利息	83
その他未払費用	165,348
(C) 純資産総額(A-B)	9,908,079,473
元本	5,736,988,793
次期繰越損益金	4,171,090,680
(D) 受益権総口数	5,736,988,793口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,271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	5,302,719,814円
期中追加設定元本額	1,460,681,270円
期中一部解約元本額	1,026,412,291円

## ○損益の状況 (2021年5月28日～2022年5月27日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 28,203円
支払利息	△ 28,203
(B) 有価証券売買損益	219,561,595
売買益	292,126,885
売買損	△ 72,565,290
(C) 信託報酬等	△ 25,480,786
(D) 当期損益金(A+B+C)	194,052,606
(E) 前期繰越損益金	1,721,316,699
(F) 追加信託差損益金	2,255,721,375
(配当等相当額)	( 5,526,978,569)
(売買損益相当額)	(△ 3,271,257,194)
(G) 計(D+E+F)	4,171,090,680
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	4,171,090,680
追加信託差損益金	2,255,721,375
(配当等相当額)	( 5,532,838,297)
(売買損益相当額)	(△ 3,277,116,922)
分配準備積立金	1,924,080,378
繰越損益金	△ 8,711,073

- (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(202,763,679円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(5,532,838,297円)および分配準備積立金(1,721,316,699円)より分配対象収益は7,456,918,675円(10,000口当たり12,997円)ですが、当期に分配した金額はありません。

# 第20期 運用報告書

(決算日 2022年5月27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20期（2021年5月28日から2022年5月27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
16期(2018年5月28日)	16,119	13.4	1,104.79	11.3	98.0	5,951
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

(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	%		%	%
2021年5月27日	19,621	—	1,248.90	—	98.1
5月末	19,762	0.7	1,273.84	2.0	98.5
6月末	19,935	1.6	1,268.04	1.5	98.9
7月末	19,498	△ 0.6	1,239.85	△ 0.7	99.1
8月末	20,103	2.5	1,278.21	2.3	99.4
9月末	21,091	7.5	1,329.67	6.5	98.3
10月末	20,826	6.1	1,312.33	5.1	98.6
11月末	20,314	3.5	1,278.86	2.4	98.7
12月末	21,070	7.4	1,325.68	6.1	99.6
2022年1月末	20,180	2.8	1,269.13	1.6	99.3
2月末	19,830	1.1	1,246.53	△ 0.2	99.2
3月末	20,909	6.6	1,300.84	4.2	98.3
4月末	20,391	3.9	1,268.00	1.5	98.2
(期末)					
2022年5月27日	20,245	3.2	1,258.06	0.7	98.1

(注1) 騰落率は期首比。

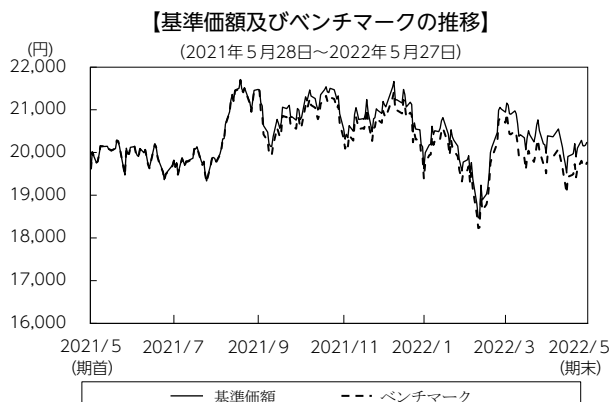
(注2) 未払金等がある場合は、株式組入比率が100%を超えることがあります。

(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（2021年5月28日から2022年5月27日まで）

### ○基準価額等の推移



(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（2021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 19,621 円から始まったあと、期末には 20,245 円となりました。期を通じて騰落率は+3.2%となりました。

	期首	期中高値	期中安値	期末
日付	2021/5/27	2021/9/14	2022/3/8	2022/5/27
基準価額（円）	19,621	21,713	18,469	20,245

## ○投資環境

---

当期の TOPIX は、1,000 ポイント近辺でスタートした後、新型コロナ感染の再拡大とワクチン接種の遅れなどから横ばい圏での推移となりました。9月に入ると菅首相（当時）の退陣表明をきっかけに急反発を見せ、同月中旬には 2,100 ポイントを回復しましたが、自民党総裁選で岸田氏の選出が決まると、成長・改革への期待感が後退し、TOPIX は 1,900～2,050 ポイントでのボックス相場に移行しました。年明け以降は、1月5日に公表された12月のFOMC（米連邦公開市場委員会）議事要旨の内容が市場の想定以上にタカ派であったことを受け、米国金利が急伸。金利上昇局面で軟調となりやすい高バリュエーション銘柄を中心に強い売り圧力に押された結果、1月下旬に 1,850 ポイント近辺まで下落しました。その後、売られすぎの反動や日米企業の良好な決算発表などを受けて戻りを試す展開となりましたが、ロシアによるウクライナ侵攻と、それを受けた各国の制裁発動への警戒感から再び売りに押される展開となり 1,750 ポイント近辺まで下落しました。また、資源価格の高騰を受け、物価上昇が各国の景気を冷やすとの懸念が高まったことも投資家心理を冷やす要因となりました。その後、原油高に一服感が見られたこと等から一時戻りを試す展開となりましたが、その動きは長続きせず、当期末の TOPIX は、1,800 ポイント後半で取引を終えました。

## ○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、+3.2%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 +0.7%をおおむね 2.5% 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

(2021年5月28日～2022年5月27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 2 ( 2)	% 0.010 (0.010)	(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	2	0.010	
期中の平均基準価額は、20,325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

(2021年5月28日～2022年5月27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
		464	1,513,956	214	574,591
		( 226)	( —)		

(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

(2021年5月28日～2022年5月27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	2,088,548千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	9,338,461千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.22

(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

(2021年5月28日～2022年5月27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 1,513	百万円 1,513	% 100.0	百万円 574	百万円 574	% 100.0

### 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)	917千円
うち利害関係人への支払額 (B)	917千円
(B) / (A)	100.0%

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

(2022年5月27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
<b>建設業(1.0%)</b>			
大和ハウス工業	15.8	16.8	53,407
積水ハウス	18.5	19.9	45,421
<b>食料品(2.3%)</b>			
アサヒグループホールディングス	12	13.7	58,060
キリンホールディングス	23.2	22.5	44,325
味の素	13	12.9	40,209
日本たばこ産業	29.3	32.8	76,456
<b>繊維製品(0.3%)</b>			
東レ	38.7	41.2	27,196
<b>化学(5.2%)</b>			
旭化成	35.4	38.7	39,977
信越化学工業	9.9	10	178,400
三菱ケミカルホールディングス	35.7	38.9	29,618
花王	13.1	13.2	67,755
富士フイルムホールディングス	9.6	10.7	73,006
資生堂	10.8	11.4	61,126
ユニ・チャーム	11.6	11.7	51,327
<b>医薬品(7.2%)</b>			
武田薬品工業	45.4	47.9	179,337
アステラス製薬	47.3	52.1	105,294
塩野義製薬	6.9	7.5	50,520
中外製薬	17.1	19.1	65,493
エーザイ	6	7.1	37,764
小野薬品工業	12.5	13.3	46,696
第一三共	46.8	46.7	158,780
大塚ホールディングス	11.3	12.3	53,271
<b>石油・石炭製品(0.5%)</b>			
ENEOSホールディングス	82	91.7	47,317
<b>ゴム製品(0.9%)</b>			
ブリヂストン	14.5	17.1	85,329
<b>鉄鋼(0.6%)</b>			
日本製鉄	25.7	26.4	58,146

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評価額
	千株	千株	千円
<b>非鉄金属(0.7%)</b>			
住友金属鉱山	6.9	7.3	39,215
住友電気工業	18.8	22	31,350
<b>機械(5.0%)</b>			
SMC	1.6	1.8	115,830
小松製作所	24.7	27.6	87,823
クボタ	28.6	29.5	68,454
ダイキン工業	6.9	7.4	143,375
マキタ	—	7.2	24,840
三菱重工業	8.6	9.4	46,953
<b>電気機器(21.7%)</b>			
日立製作所	26.2	29.3	195,167
東芝	—	10.6	61,056
三菱電機	54.5	59.6	82,307
日本電産	13.1	15	124,005
オムロン	—	5.1	35,898
富士通	4.9	5.5	104,720
パナソニック ホールディングス	58.2	65	76,667
ソニーグループ	34.2	38.2	436,435
キーエンス	5.4	5.5	269,775
シスメックス	4.3	4.9	37,779
レーザーテック	—	2.6	45,890
ファナック	4.8	5.3	107,934
京セラ	8.3	8.6	62,461
村田製作所	16	17.5	139,387
キヤノン	27.1	30.3	97,687
東京エレクトロン	3.2	3.9	230,568
<b>輸送用機器(10.7%)</b>			
デンソー	12	12.9	97,098
日産自動車	64.3	71.9	35,245
トヨタ自動車	55.2	298.4	621,865
本田技研工業	42.9	46.8	147,139
スズキ	10.8	13.3	49,449

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
SUBARU	15.6	17	35,810
シマノ	2	2.4	53,352
<b>精密機器(3.3%)</b>			
テルモ	16.7	17.2	71,534
オリンパス	30.2	31.1	83,005
HOYA	10.7	11.9	163,030
<b>その他製品(2.5%)</b>			
バンドダイナムコホールディングス	4.5	5.3	50,715
任天堂	3.1	3.4	192,780
<b>電気・ガス業(一%)</b>			
中部電力	16.7	—	—
関西電力	20.7	—	—
東京瓦斯	10.5	—	—
<b>陸運業(1.9%)</b>			
東日本旅客鉄道	9.6	10.2	68,309
西日本旅客鉄道	4.9	7.1	34,072
東海旅客鉄道	4.5	4.8	78,936
<b>空運業(0.4%)</b>			
ANAホールディングス	13.9	14.4	37,526
<b>情報・通信業(8.4%)</b>			
Zホールディングス	73.5	86.2	35,523
日本電信電話	62.6	64	255,744
KDDI	42.9	43.6	198,118
ソフトバンク	48.6	90.6	136,262
ソフトバンクグループ	42.5	35.9	191,741
<b>卸売業(6.5%)</b>			
伊藤忠商事	37.6	40	147,000
丸紅	53	57	76,066
三井物産	43.6	45.6	143,640
住友商事	33.9	37.1	68,542
三菱商事	32.7	43.1	192,527
<b>小売業(2.5%)</b>			
セブン&アイ・ホールディングス	21	22.4	117,868
イオン	20.7	22	50,996
ニトリホールディングス	2.1	2.4	30,600

銘柄	期首(前期末)	当期末		
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
ファーストリテイリング	0.7	0.8	47,720	
<b>銀行業(6.4%)</b>				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	367.9	368.5	272,247	
りそなホールディングス	62.1	66.6	31,981	
三井住友トラスト・ホールディングス	10.2	10.9	42,292	
三井住友フィナンシャルグループ	37.2	40.7	161,172	
みずほフィナンシャルグループ	73.1	75.3	114,568	
<b>証券、商品先物取引業(0.7%)</b>				
大和証券グループ本社	40.3	43.9	27,389	
野村ホールディングス	82.1	91.8	45,991	
<b>保険業(3.3%)</b>				
SOMPOホールディングス	9.5	9.4	54,491	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	13.1	13.1	52,648	
第一生命ホールディングス	28.4	28	72,296	
東京海上ホールディングス	17.7	18.4	136,712	
<b>その他金融業(1.2%)</b>				
オリックス	32.7	35.7	86,429	
日本取引所グループ	14.5	14.7	29,444	
<b>不動産業(1.9%)</b>				
三井不動産	24.5	26	73,411	
三菱地所	35.3	37.7	73,628	
住友不動産	12.1	12	41,964	
<b>サービス業(4.9%)</b>				
エムスリー	9.2	10.3	37,069	
オリエンタルランド	5.5	6.7	131,052	
リクルートホールディングス	37.3	43.9	193,160	
日本郵政	39.4	72.9	69,291	
セコム	5.1	5.7	47,840	
合計	株数・金額	2,769	3,245	9,707,125
	銘柄数<比率>	99	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少数で記載。

## ○投資信託財産の構成

(2022年5月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 9,707,125	% 98.1
コール・ローン等、その他	190,244	1.9
投資信託財産総額	9,897,369	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 (2022年5月27日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,897,369,130円
コール・ローン等	85,338,690
株式(評価額)	9,707,125,260
未取配当金	104,905,180
(B) 負債	1,069
未払利息	233
その他未払費用	836
(C) 純資産総額(A - B)	9,897,368,061
元本	4,888,750,763
次期繰越損益金	5,008,617,298
(D) 受益権総口数	4,888,750,763口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,245円

<注記事項>

(貸借対照表関係)

期首元本額	4,528,055,659円
期中追加設定元本額	725,665,152円
期中一部解約元本額	364,970,048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)	4,888,750,763円

## ○損益の状況 (2021年5月28日～2022年5月27日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	228,272,668円
受取配当金	228,293,778
その他収益金	45,888
支払利息	△ 66,998
(B) 有価証券売買損益	53,491,903
売買益	814,726,612
売買損	△ 761,234,709
(C) その他費用	△ 1,309
(D) 当期損益金(A + B + C)	281,763,262
(E) 前期繰越損益金	4,356,549,140
(F) 追加信託差損益金	753,334,848
(G) 解約差損益金	△ 383,029,952
(H) 計(D + E + F + G)	5,008,617,298
次期繰越損益金(H)	5,008,617,298

(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。