

# 野村グローバル・ロング・ショート

追加型投信／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）

## 償還交付運用報告書

第8期（償還日2018年10月25日）

作成対象期間（2018年3月6日～2018年10月25日）

第8期末（2018年10月25日）	
償還価額	10,582円55銭
純資産総額	307百万円
第8期	
騰落率	△3.0%
分配金（税込み）合計	－円

(注) 騰落率は分配金（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、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

- 交付運用報告書は、運用報告書に記載すべき事項のうち重要なものを記載した書面です。その他の内容については、運用報告書（全体版）に記載しております。
- 当ファンドは、投資信託約款において運用報告書（全体版）に記載すべき事項を、電磁的方法によりご提供することができる旨を定めております。運用報告書（全体版）は、野村アセットマネジメントのホームページで閲覧・ダウンロードしていただけます。
- 運用報告書（全体版）は、受益者の方からのご請求により交付されます。交付をご請求される方は、販売会社までお問い合わせください。

<運用報告書（全体版）の閲覧・ダウンロード方法>

右記ホームページを開く

⇒「ファンド検索」にファンド名を入力しファンドを選択

⇒ファンド詳細ページから「運用報告書（全体版）」を選択

### 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。

当ファンドは、グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド受益証券への投資を通じて、内外の短期有価証券を主要投資対象とし、世界主要国の株価指数先物取引および債券先物取引を主要取引対象とし、為替予約取引等も積極的に活用します。日本円の短期金利水準を上回る収益の獲得を目指して積極的な運用を行いました。

このたび、約款の規定にもとづき償還決算を行い、償還価額が決定いたしました。

ここに設定日から償還までの運用経過をご報告いたしますとともに、ご愛顧に対し厚く御礼申し上げます。

## 野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

（受付時間）営業日の午前9時～午後5時

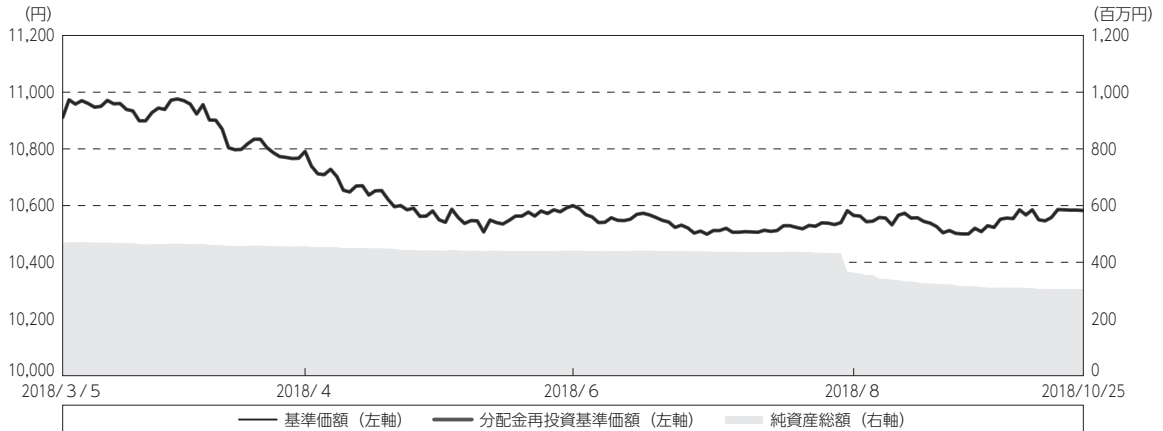


ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## 運用経過

## 期中の基準価額等の推移

(2018年3月6日～2018年10月25日)



期 首 : 10,911円

期末 (償還日) : 10,582円55銭 (既払分配金 (税込み) : -円)

騰 落 率 : △3.0% (分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、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。作成期首 (2018年3月5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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) ベンチマークは、日本円1ヵ月LIBOR (London Inter-Bank Offered Rate) ですが、基準価額と併記する形でのグラフ掲載はしていません。

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

## ○基準価額の主な変動要因

<株式部分はプラスに寄与、債券、為替部分はマイナスに影響>

(株式/+) 概ね売り建てていた英国株はマイナスに影響しましたが、概ね買い建てていた日本株、フランス株はプラスに寄与しました。

(債券/-) 売り建てていたドイツ債、買い建てていたカナダ債はマイナスに影響しました。

(為替/-) 売り建てていたスウェーデン・クローナはプラスに寄与しましたが、特に3月から5月にかけて売り建てていたカナダ・ドル、機動的にポジションを変更した英ポンドはマイナスに影響しました。

## 1万口当たりの費用明細

(2018年3月6日～2018年10月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信託報酬 (基本報酬)	円 114	% 1.073	(a) 信託報酬 (基本報酬) = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率
(a) 信託報酬 (基本報酬) ( 投信会社 )	( 59 )	(0.554)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
(a) 信託報酬 (基本報酬) ( 販売会社 )	( 52 )	(0.485)	購入後の情報提供、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および事務手続き等
(a) 信託報酬 (基本報酬) ( 受託会社 )	( 4 )	(0.035)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 信託報酬 (成功報酬)	—	—	(b) 信託報酬 (成功報酬) は、基本報酬額に加えて、委託会社が受領するハイ・ウォーターマーク方式による成功報酬額で、一定時点毎の基準価額が過去の一定時点における最高値を更新している場合に受領する仕組みになっています。
(c) 売買委託手数料	4	0.037	(c) 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) 売買委託手数料 ( 先物・オプション )	( 4 )	(0.037)	
(d) その他費用	3	0.031	(d) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(d) その他費用 ( 監査費用 )	( 0 )	(0.002)	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
(d) その他費用 ( その他 )	( 3 )	(0.029)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	121	1.141	
期中の平均基準価額は、10,640円です。			

(注) 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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み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) 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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## 最近5年間の基準価額等の推移

(2013年3月5日～2018年10月25日)



- (注) 分配金再投資基準価額は、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。2013年3月5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) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) ベンチマークは、日本円1ヵ月LIBORですが、基準価額と併記する形でのグラフ掲載はしておりません。

	2013年3月5日 決算日	2014年3月5日 決算日	2015年3月5日 決算日	2016年3月7日 決算日	2017年3月6日 決算日	2018年3月5日 決算日	2018年10月25日 償還日
基準価額 (円)	10,621	11,145	10,808	10,894	10,841	10,911	10,582.55
期間分配金合計(税込み) (円)	—	10	10	10	10	10	—
分配金再投資基準価額騰落率(%)	—	5.0	△ 2.9	0.9	△ 0.4	0.7	△ 3.0
ベンチマーク騰落率(%)	—	0.1	0.1	0.1	△ 0.1	△ 0.0	△ 0.0
純資産総額 (百万元)	135	586	815	864	692	470	307

(注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

(注) 純資産総額の単位未満は切捨てて表示しております。

(注) 騰落率は1年前の決算当日との比較です。ただし、償還日の騰落率は償還日の直前の決算日との比較です。

## 投資環境

(2018年3月6日～2018年10月25日)

## ・市場概況

株式市場では、3月、豪州株は1月の小売売上高や2月の雇用者数変化が前月比で市場予想を下回ったことなどを背景に下落しました。4月、欧州株は米中貿易摩擦の深刻化懸念が後退したことや、月末にECB（欧州中央銀行）が金融政策の正常化を慎重に進めるとの見方からユーロ安が進行したことを背景に上昇しました。5月、イタリア株は新興政党と極右政党との連立協議が合意され、減税などによる歳出拡大懸念やユーロ圏離脱を問う再選挙の可能性が浮上したことなど政治情勢の不安定化を背景に下落しました。6月、香港株は中国経済の景気減速懸念が高まりをみせたことや、トランプ米大統領が中国製品に対し追加関税を課すと警告したことを背景に下落しました。7月、欧州株はドイツのメルケル首相が米国の自動車への輸入関税引き下げに前向きな姿勢を示したことやトランプ米大統領がEU（欧州連合）と貿易摩擦回避の方針で合意したことなどを背景に上昇しました。8月、米国株は企業決算や経済指標が市場予想を上回る良好な結果となったことやNAFTA（北米自由貿易協定）再交渉をめぐりメキシコとの2国間協議が合意に至ったことなどを背景に上昇しました。9月、日本株は7月の機械受注が市場予想を上回ったことや、8月のCPI（消費者物価指数）が市場予想を上回ったことなどを背景に上昇しました。

債券市場では、3月、ドイツ債は2月のユーロ圏CPIの前年比伸び率が市場予想を下回ったことなどを背景に上昇しました。4月、カナダ債は中央銀行総裁が議会証言で国内経済について明るい見通しを示唆したことや、原油価格の上昇などを背景に下落しました。5月、ドイツ債は4月のユーロ圏CPIが市場予想を下回ったことや、イタリア情勢を警戒したリスク回避姿勢が高まりをみせたことを背景に上昇しました。6月、ドイツ債は南欧の政局不安の警戒感や政権内部での移民・難民問題をめぐる対立などを背景に上昇しました。7月、カナダ債は5月の製造業売上高（前月比）や6月のCPI（前年比）が市場予想を上回ったことなどを背景に年内追加利上げ観測が高まり下落しました。8月、ドイツ債はイタリアの政治情勢をめぐる先行き不透明感や、トルコリラ急落による欧州銀行のトルコ向け債権に対する警戒感などを背景に安全資産が選好され上昇しました。9月、米国債は米国景気の堅調さを示す経済指標の発表が相次いだことやFOMC（米連邦公開市場委員会）で利上げが実施されたことを背景に下落しました。

為替市場では、3月、英ポンドは2月のサービス業PMI（購買担当者景気指数）が市場予想を上回ったことや、EU離脱後の激変緩和策である「移行期間」の扱いについて承認されたことなどを背景に上昇しました。4月、カナダ・ドルは3月の住宅着工件数が市場予想を上回ったことや原油価格が上昇したことなどを背景に上昇しました。5月、ユーロはユーロ圏の経済指標が軟調であったことや、スペインの首相に対する不信任動議の動きやイタリアの政局をめぐる不透明感などを背景に下落しました。6月、米ドルは5月の米雇用統計が市場予想を上回ったことや、FRB（米連邦準備制度理事会）議長が利上げに積極的な姿勢をみせたことなどを背景に上昇しました。7月、スウェーデン・クローナは中央銀行総裁が利上げを示唆したことや、4-6月期の実質GDP（国内総生産）成長率（前期比）が市場予想を上回ったことなどを背景に上昇しました。8月、豪ドルは7月のPMIが前月比で低下したことや、リスクオフの流れなどから対円で下落しました。9月、米ドルは米中通商協議が再開されるとの報道やトルコの大規模利上げによる世界的な株式市場の上昇、またFOMCによる利上げが実施されたことなどを背景に対円で上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

(2018年3月6日～2018年10月25日)

## [野村グローバル・ロング・ショート]

主要投資対象である [グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド] を高位に組み入れました。

繰上げ償還の方針決定後、[グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド] の売却を実施し、現金化しました。

## [グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド]

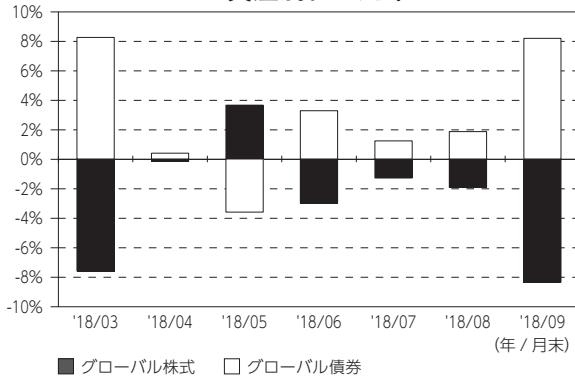
## ・期中の主な動き

**【株式】** 豪州株は通貨の観点から魅力度が上昇、売り建てから買い建てに変更しました。一方、日本株はボラティリティ（価格変動性）の観点から魅力度が低下、買い建てから売り建てに変更しました。

**【債券】** カナダ債は相対的な長短金利差の観点から魅力度が上昇、さらに買い建てしました。一方、豪州債は相対的な長短金利差の観点から魅力度が低下、さらに売り建てしました。

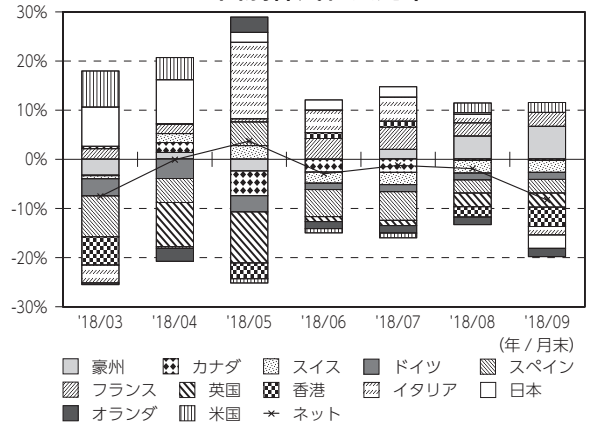
**【為替】** カナダ・ドルは相対的な長期金利の上昇から魅力度が上昇、売り建てから買い建てに変更しました。一方、スウェーデン・クローナは株式市場からの資金流出懸念から魅力度が低下、さらに売り建てしました。

<資産別組入比率>



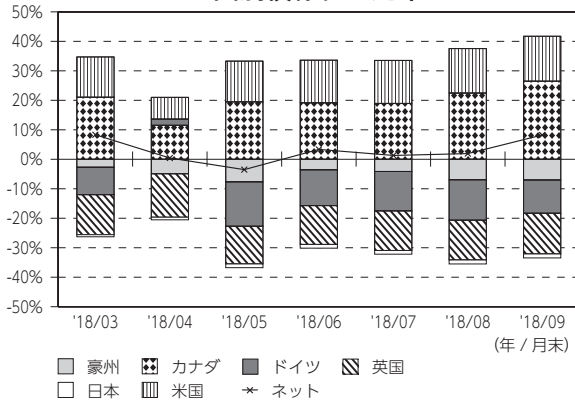
\*組入比率はマザーファンドの純資産比率です。

<国別株式組入比率>



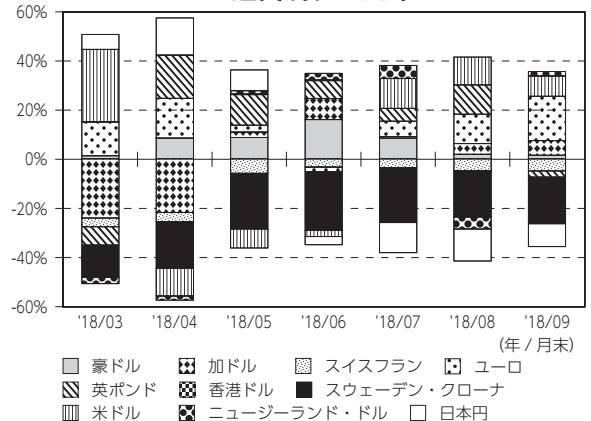
\*組入比率はマザーファンドの純資産比率です。

<国別債券組入比率>



\*組入比率はマザーファンドの純資産比率です。

<通貨別組入比率>



\*組入比率はマザーファンドの純資産比率です。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

(2018年3月6日～2018年10月25日)

### \*ベンチマーク対比では2.97ポイントのマイナス

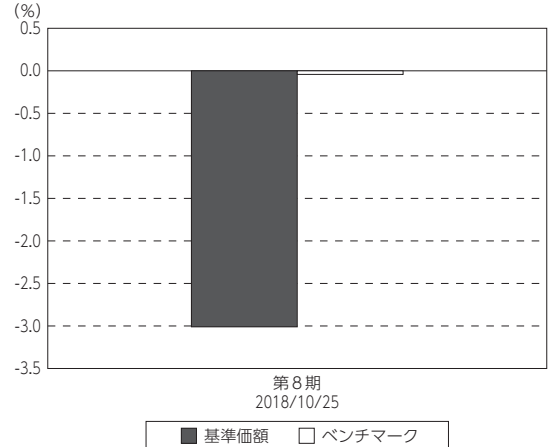
基準価額の騰落率は-3.01%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの-0.04%を2.97ポイント下回りました。

#### 【主な差異要因】

株式部分はプラスに寄与しましたが、債券部分、為替部分はマイナスに影響しました。

株式部分では、概ね売り建てていた英国株はマイナスに影響しましたが、概ね買い建てていた日本株、フランス株はプラスに寄与しました。債券部分では、売り建てていたドイツ債、買い建てていたカナダ債はマイナスに影響しました。為替部分では、売り建てていたスウェーデン・クローナはプラスに寄与しましたが、特に3月から5月にかけて売り建てていたカナダ・ドル、機動的にポジションを変更した英ポンドはマイナスに影響しました。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) ベンチマークの騰落率は、日本円1ヵ月LIBORをもとに、当社が独自に累積再投資して算出しております。

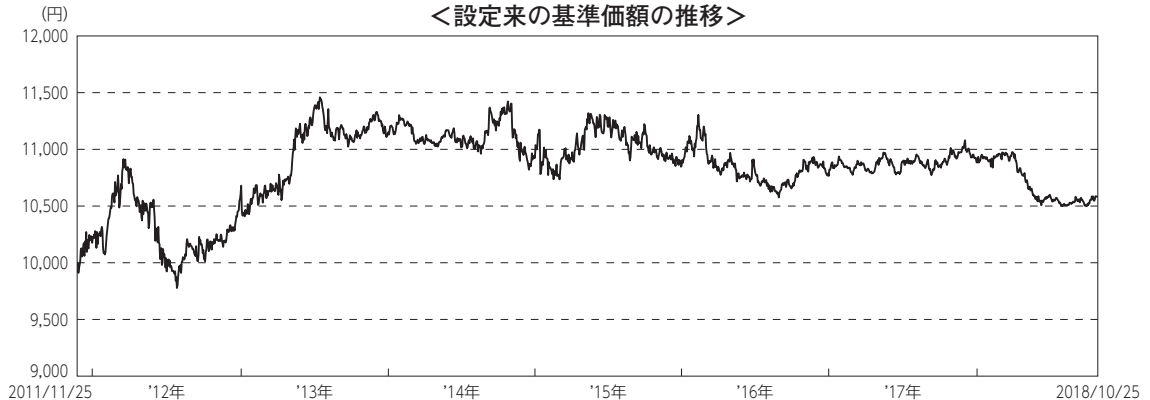
## 分配金

(2018年3月6日～2018年10月25日)

償還のため分配は行いませんでした。



## 設定来の運用経過



### ○基準価額の推移

基準価額は、設定時の10,000円が償還時10,582.55円となりました。設定来お支払した分配金は1万円当たり70円となりました。

#### 第1期 (2011年11月25日～2012年3月5日)

基準価額の騰落率は+7.80%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの+0.04%を7.76ポイント上回りました。

#### 第2期 (2012年3月6日～2013年3月5日)

基準価額の騰落率は-1.29%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの+0.14%を1.43ポイント下回りました。

#### 第3期 (2013年3月6日～2014年3月5日)

基準価額の騰落率は+5.03%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの+0.12%を4.91ポイント上回りました。

#### 第4期 (2014年3月6日～2015年3月5日)

基準価額の騰落率は-2.93%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの+0.09%を3.03ポイント下回りました。

#### 第5期 (2015年3月6日～2016年3月7日)

基準価額の騰落率は+0.89%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの+0.05%を0.84ポイント上回りました。

**第6期（2016年3月8日～2017年3月6日）**

基準価額の騰落率は-0.39%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの-0.06%を0.33ポイント下回りました。

**第7期（2017年3月7日～2018年3月5日）**

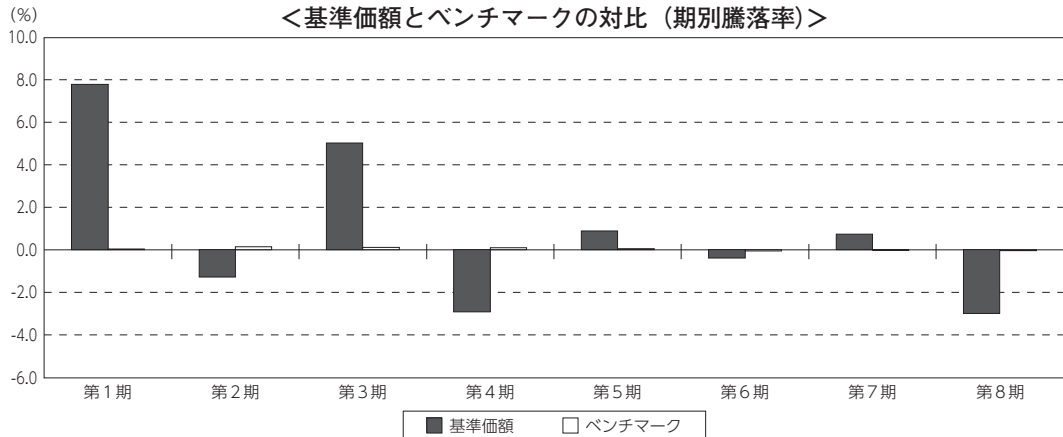
基準価額の騰落率は+0.74%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの-0.03%を0.77ポイント上回りました。

**第8期（2018年3月6日～2018年10月25日）**

基準価額の騰落率は-3.01%となり、ベンチマークである日本円1ヵ月LIBORの-0.04%を2.97ポイント下回りました。

**○ベンチマークとの差異**

設定来の基準価額とベンチマークの対比は、以下のようになりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) ベンチマークの騰落率は、日本円1ヵ月LIBORをもとに、当社が独自に累積再投資して算出しております。

当ファンドは、2018年10月25日をもちまして繰上償還となりました。  
ご愛顧いただき、厚く御礼申し上げます。

## お知らせ

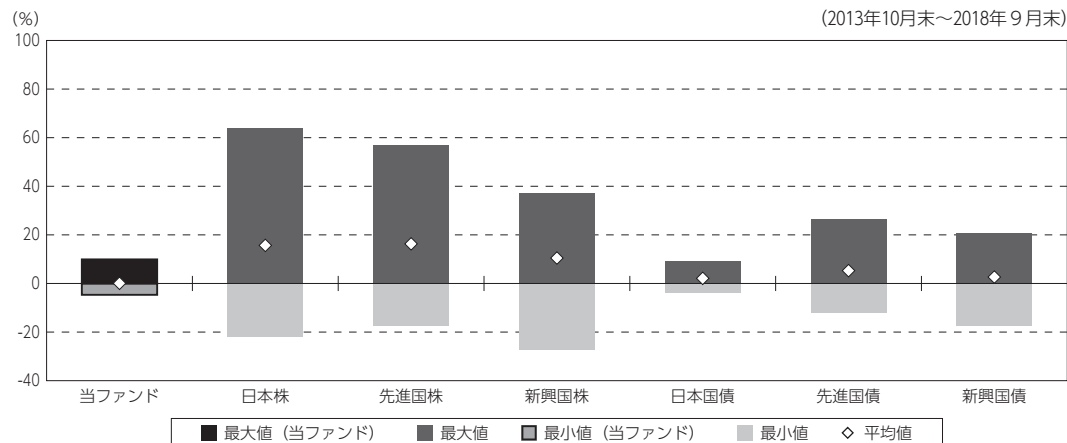
該当事項はございません。

## 当ファンドの概要

商品分類	追加型投信／内外／資産複合／特殊型（絶対収益追求型）	
信託期間	2018年10月25日をもちまして繰上償還いたします。（設定日2011年11月25日）	
運用方針	<p>グローバル・アセット・モデル・ファンド マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券への投資を通じて、主として内外の短期有価証券に投資し安定した収益の確保を目指すとともに、世界主要国の株価指数先物取引、債券先物取引等の有価証券先物取引等および為替予約取引等の積極的な活用により日本円の短期金利水準を上回る収益の獲得を目指して積極的な運用を行うことを基本とします。</p> <p>有価証券先物取引等および為替予約取引等の活用に当たっては、Global Tactical Asset Allocation（グローバルな戦術的資産配分。GTAA）モデル及びTactical Currency Allocation（戦術的通貨配分。TCA）モデルに基づき、市場データの精緻な分析により、推定される均衡水準から時価が乖離している資産・通貨に係るデリバティブ等を売買し、時価が均衡水準に収斂する過程での収益を獲得することを目指します。</p>	
主要投資対象	野村グローバル・ロング・ショート	マザーファンドの受益証券を主要投資対象とします。なお、短期有価証券等に直接投資する場合があります。
	マザーファンド	内外の短期有価証券を主要投資対象とし、世界主要国の株価指数先物取引および債券先物取引を主要取引対象とし、為替予約取引等も積極的に活用します。
運用方法	マザーファンド受益証券への投資を通じて、内外の短期有価証券を主要投資対象とし、世界主要国の株価指数先物取引および債券先物取引を主要取引対象とし、為替予約取引等も積極的に活用します。日本円の短期金利水準を上回る収益の獲得を目指して積極的な運用を行うことを基本とします。	
配分方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益等から、基準価額水準等を勘案して委託者が決定します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

## (参考情報)

## ○当ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



(単位：%)

	当ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
最大値	9.9	64.2	57.1	37.2	9.3	26.6	20.8
最小値	△ 4.7	△ 22.0	△ 17.5	△ 27.4	△ 4.0	△ 12.3	△ 17.4
平均値	0.1	15.7	16.3	10.5	2.1	5.3	2.7

(注) 全ての資産クラスが当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 2013年10月から2018年9月の5年間の各月末における1年間の騰落率の最大値・最小値・平均値を表示したものです。

(注) 決算日に対応した数値とは異なります。

(注) 当ファンドは分配金再投資基準価額の騰落率です。

## 《代表的な資産クラスの指数》

日本株：東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

先進国株：MSCI-KOKUSAI指数 (配当込み、円ベース)

新興国株：MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

日本国債：NOMURA-BPI国債

先進国債：FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

新興国債：JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)

※各指数についての説明は、後述の「代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について」をご参照ください。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しております。

## 当ファンドのデータ

### 組入資産の内容

(2018年10月25日現在)

2018年10月25日現在、有価証券等の組入れはございません。

マザーファンドの直近の計算期間の内容につきましては、償還運用報告書（全体版）に記載しております。

### 純資産等

項 目	第8期末(償還日)	
	2018年10月25日	
純資産総額	307,733,352円	
受益権総口数	290,793,175口	
1万口当たり償還価額	10,582円55銭	

(注) 期中における追加設定元本額は15,677,218円、同解約元本額は155,702,573円です。

## <代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について>

### ○東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)

東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) は、株式会社東京証券取引所 (㈱東京証券取引所) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、(株)東京証券取引所が有しています。なお、本商品は、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではなく、(株)東京証券取引所は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

### ○MSCI-KOKUSAI指数 (配当込み、円ベース)

#### ○MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)

MSCI-KOKUSAI指数 (配当込み、円ベース)、MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース) は、MSCIが開発した指数です。同指数に対する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCIに帰属します。またMSCIは、同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。

### ○NOMURA-BPI国債

NOMURA-BPI国債の知的財産権は、野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、NOMURA-BPI国債の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI国債を用いて行われる野村アセットマネジメント株式会社の事業活動、サービスに関し一切責任を負いません。

### ○FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)

FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。同指数はFTSE Fixed Income LLCの知的財産であり、指数に関するすべての権利はFTSE Fixed Income LLCが有しています。

### ○JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)

「JPMorgan・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバースファイド (円ベース)」(ここでは「指数」とよびます) についてここに提供された情報は、指数のレベルも含め、但しそれに限定することなく、情報としてのみ使用されるものであり、金融商品の売買を勧誘、何らかの売買の公式なコンファメーション、或いは指数に関連する何らかの商品の価値や値段を決めるものでもありません。また、投資戦略や税金における会計アドバイスを法的に推奨するものでもありません。ここに含まれる市場価格、データ、その他の情報は確かなものと考えられますが、JPMorgan Chase & Co. 及びその子会社 (以下、JPM) がその完全性や正確性を保証するものではありません。含まれる情報は通知なしに変更されることがあります。過去のパフォーマンスは将来のリターンを示唆するものではありません。本資料に含まれる発行体の金融商品について、JPMやその従業員がロング・ショート両方を含めてポジションを持ったり、売買を行ったり、またはマーケットメイクを行ったりすることがあり、また、発行体の引受人、プレースメント・エージェンシー、アドバイザー、または貸主になっている可能性もあります。

米国のJ.P. Morgan Securities LLC (ここでは「JPMSLLC」と呼びます) (「指数スポンサー」) は、指数に関する証券、金融商品または取引 (ここでは「プロダクト」と呼びます) についての援助、保障または販売促進を行いません。証券或いは金融商品全般、或いは特にプロダクトへの投資の推奨について、また金融市場における投資機会を指数に連動させる或いはそれを目的とする推奨の可否について、指数スポンサーは一切の表明または保証、或いは伝達または示唆を行なうものではありません。指数スポンサーはプロダクトについての管理、マーケティング、トレーディングに関する義務または法的責任を負いません。指数は信用できると考えられる情報によって算出されていますが、その完全性や正確性、また指数に付随する情報について保証するものではありません。指数は指数スポンサーが保有する財産であり、その財産権はすべて指数スポンサーに帰属します。

JPMSLLCはNASDAQ, NYSE, SIPCの会員です。JPMorganはJP Morgan Chase Bank, NA, JPSI, J.P. Morgan Securities PLC., またはその関係会社が投資銀行業務を行う際に使用する名称です。

(出所：株式会社野村総合研究所、FTSE Fixed Income LLC 他)