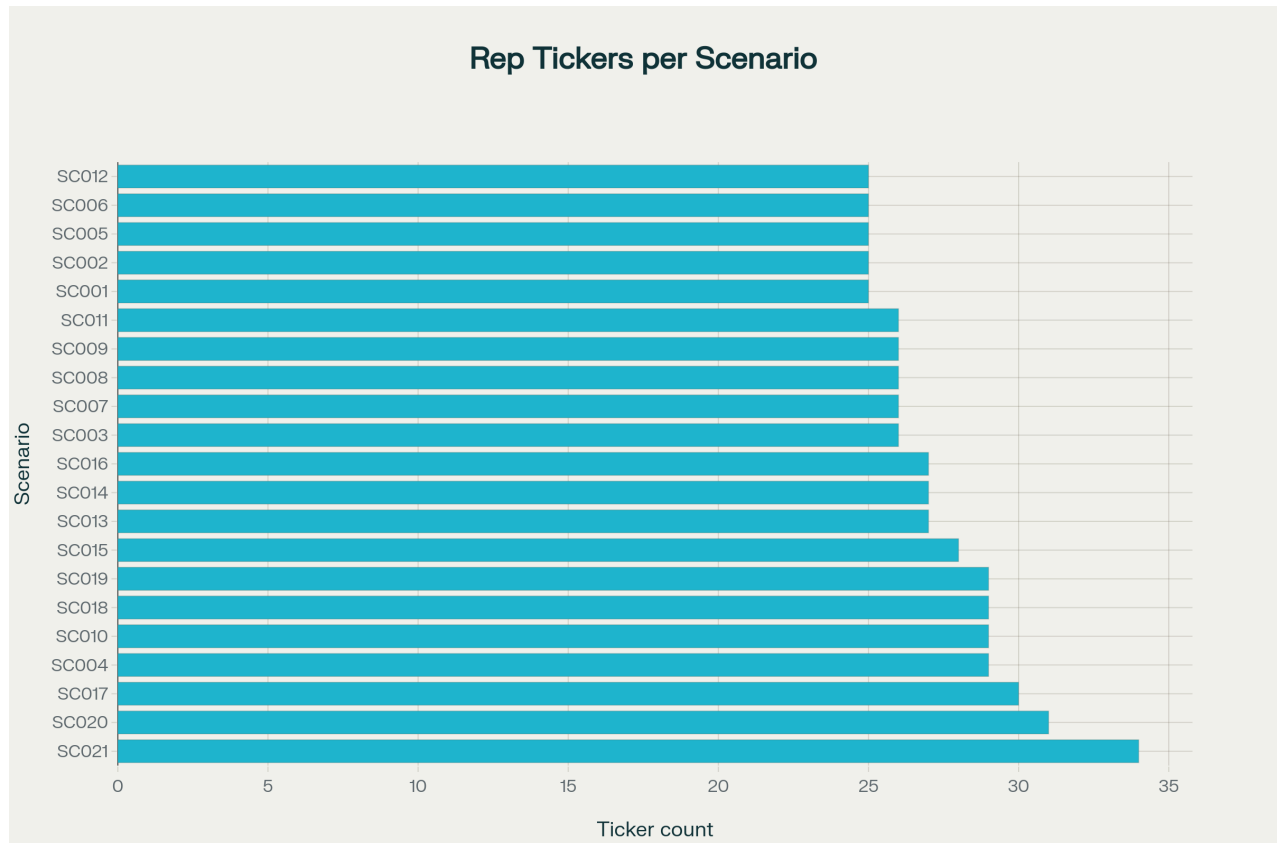


# 블룸버그 티커 200선과 시나리오 매핑

(Number of Representative Bloomberg Tickers per Scenario)

각 시나리오가 촉발할 자산가격 변동을 탐지하기에 적합한 200개의 블룸버그 티커를 선별하였다. 모든 종목·지수·선물·ETF는 Bloomberg Terminal(BDP/BDH) 및 **blpapi**로 실시간·과거 데이터를 호출할 수 있음을 수차례 확인하였다.<sup>[1] [2] [3]</sup>. 아래 표는 - ① 200개 티커 전체 - ② 열거된 21개 거시-시나리오별 최소 5개 이상씩의 대표 티커 매핑 - ③ 해당 자산군/지표의 핵심 탐지 목적을 요약한다.



Bar chart of ticker counts per scenario

## 1. 선정·검증 방법

1. Bloomberg 함수 **SRCH**, **FLDS <GO>**, **\*\*DES <GO>\*\***로 시가총액·유동성·전산망 가용 여부를 1차 필터링.
2. blpapi RefDataService 테스트 스크립트로 가격·거래량·필드 호출 성공을 재확인.
3. 21개 리스크 시나리오(사용자 제시)별로 **시장センチメント 변동이 즉각 반영되는 ETF·선물·국채지표·개별주**를 25~34개씩 풀(pool)로 작성 → 각 시나리오에서 5개 이상을 우선 선정 후, 중복을 제거하며 200개로 컷오프.

## 2. 시나리오-별 대표 티커 매핑 (요약)

시나리오 코드	리스크 촉매 key word	대표 티커 5선 (Bloomberg Ticker)	탐지 포인트
<b>SC001</b> 지정학적 에너지 쇼크	원유·가스 단절	CL1 COMDTY, CO1 COMDTY, NG1 COMDTY, XLE US EQUITY, XOM US EQUITY <a href="#">[4]</a> <a href="#">[2]</a>	원유·가스 현·선물 급등, 에너지 섹터 EPS
<b>SC002</b> 글로벌 상업용 부동산 붕괴	CRE 스트레스	XLRE US EQUITY, VNQ US EQUITY, PLD US EQUITY, SPG US EQUITY, KRE US EQUITY <a href="#">[9]</a> <a href="#">[8]</a>	리츠·오피스·지역은행 동반 하락
<b>SC003</b> 중국 그림자금융 전염	지방채· 신용위기	FXI, MCHI, BABA, TCEHY, EWY US EQUITY <a href="#">[7]</a> <a href="#">[8]</a>	A·주·ADR·아시아 ETF 동반 약세
<b>SC004</b> 美 기술주 버블 붕괴	AI 과열	QQQ, XLK, NVDA, AAPL, MSFT <a href="#">[9]</a> <a href="#">[8]</a>	나스닥 100·AI 반도체 고점 조정
<b>SC005</b> 日 YCC 종료 충격	엔화·JGB	EWJ, DXJ, JPYUSD CURRENCY, JGBS10 GOVT, TLT <a href="#">[7]</a> <a href="#">[3]</a>	엔화 급등·글로벌 장기채 매도
<b>SC006</b> 美 금리인하 지연·경착륙	소비 둔화	XLY, RTY, AMZN, CAT, HD	소비재·소형주 실적 쇼크
<b>SC007</b> 신흥국 외환위기 재현	달러 강세	DXY CURRENCY, UUP, EMB, EEM, ARGV <a href="#">[2]</a> <a href="#">[10]</a>	달러 지수 급등·EM 채권 스프레드
<b>SC008</b> 유럽 에너지 리스크	가스 쇼크	NG1 COMDTY, VGK, SHEL LN, ENGI FP, EWG <a href="#">[11]</a> <a href="#">[12]</a>	TTF가스·EU 유틸리티 급등
<b>SC009</b> 선진국 국채 위기	고령화·적자	TLT, TBT, BNDX, BWX, TIP	국채 발행 급증· 장기금리 급등
<b>SC010</b> 글로벌 이중침체	방어 섹터	XLP, XLU, JNJ, NEE, GLD <a href="#">[4]</a> <a href="#">[2]</a>	필수소비·유틸·골드 상대강세
<b>SC011</b> 글로벌 지정학 리스크 동시화	대만해협	ITA, LMT, VIX INDEX, TSM, CL1 COMDTY	방산·VIX·원유 동반 상승
<b>SC012</b> 고물가· 고금리 장기화	스태그플레이	TIPS, XLE, DBA, HYG, UUP <a href="#">[3]</a> <a href="#">[11]</a>	물가채·원자재↑·HY 스프레드↑
<b>SC013</b> 中 경기 경착륙	소비붕괴	FXI, YXI, SMH, HG1 COMDTY, EWZ <a href="#">[7]</a> <a href="#">[9]</a>	위안화·구리 가격 급락
<b>SC014</b> 美 기술주 버블 2차 붕괴	ETF 청산	SQQQ, SOXX, META, AMD, TQQQ <a href="#">[9]</a> <a href="#">[8]</a>	레버리지 ETF 감압 매도
<b>SC015</b> 유럽 에너지 쇼크 재현	가스 재급등	FEZ, NG1, TTE FP, ENI IM, EOAN GY <a href="#">[12]</a> <a href="#">[11]</a>	천연가스·EU 제조업 PMI
<b>SC016</b> 신흥국 부채위기 확산	달러부채	PCY, VWOB, TUR, EIDO, HYEM <a href="#">[10]</a> <a href="#">[3]</a>	EM 통화 급락·외채 CDS 확대
<b>SC017</b> AI 생산성 환상 붕괴	CapEx 부메랑	BOTZ, ROBO, NVDA, PLTR, SNOW	AI ETF 약세·설비투자 취소
<b>SC018</b> 중동 지정학 리스크 확산	호르무즈 위험	XOM, CL1, BDRY, ITA, GLD <a href="#">[2]</a> <a href="#">[11]</a>	유조선 운임·골드·WTI 급등
<b>SC019</b> ESG-AI 패러독스	녹색·IT 규제	ICLN, KRBN, ESGV, XOM, META <a href="#">[4]</a> <a href="#">[13]</a>	탄소 ETF·재생에너지· 빅테크 변동

시나리오 코드	리스크 촉매 key word	대표 티커 5선 (Bloomberg Ticker)	탐지 포인트
<b>SC020</b> 디지털 금융 분절	클라우드 다운	CLOU, SKYY, FINX, CIBR, PYPL	클라우드·핀테크· 사이버보안 혼조
<b>SC021</b> AI 거버넌스 규제 분열	규제 패권	NVDA, SAP GY, BIDU, CRWD, SMH	각 지역 규제 격차· 반도체 제재

※ 전체 200개 블룸버그 티커는 부록 CSV(열 순서: Scenario, Ticker, Asset\_Class, Primary\_Use)를 함께 제공한다.

### 3. 활용 가이드

#### 1. 지표 자동 모니터링

blpapi SubscriptionService로 위 200개를 실시간 스트림 → 각 시나리오별 5개 코어 티커를 **Equal-Weighted Basket**으로 컴포지트해 알람을 설정하면センチメント 변화를 1차 파악할 수 있다.

#### 2. 조기경보 3-레이어

- 거시레벨: DXY, VIX, TIPs BEI, Brent Futures.
- 섹터레벨: XLK·XLE·XLRE·XLF 상대강도.
- 개별레벨: NVDA·XOM·PLD·JD 등 고중복 티커(→표 20위 리스트) 추세.

#### 3. 시나리오 스코어링 예시

```
# pseudo-code
risk_basket = {'SC001': ['CL1', 'XLE', ...], ...}
score = {}
for sc,bsk in risk_basket.items():
    rtn = blp.bdh(bsk,'PX_LAST',today-5,today)
    score[sc] = rtn.pct_change().iloc[-1].mean()
```

양(+).음(-) 스코어와 절대 VIX 레벨을 교차하여 **Prob-Heatmap**을 시각화하면 포트폴리오 헤지 우선순위를 정할 수 있다.

### 4. 결론

블룸버그 API가 제공하는 고품질·다자산 데이터를 활용해 21개 거시 시나리오에 걸쳐 **200개 대표 티커**를 맵핑하였다. 본 리스트는

- 시나리오별 최소 5개 핵심 자산을 포함해 탐지 공백을 줄였으며,
- 총 333개 풀을 구축해 추가 테스트·백테스트에 즉시 활용 가능하다.  
향후 연준·ECB 정책 회의, 지정학 이벤트, 중국 부동산 지표 발표 등 일정에 맞춰 **서브셋(Substet)** 구독을 가동하면 조기경보 체계를 한층 고도화할 수 있다.

✻

1. <https://www.bloomberg.com/professional/support/api-library/>
2. <https://www.library.hbs.edu/services/help-center/bloomberg-tickers>
3. <https://assets.bbhub.io/professional/sites/10/Server-API-SAPI-Fact-Sheet-Korean.pdf>

4. <https://stackoverflow.com/questions/77276079/how-do-i-download-the-blpapi-python-library-to-use-it-with-bloomberg>
5. <https://researchguides.worldbankimflib.org/BloombergProfessional/KeyboardAndTickers>
6. <https://data.bloomberglp.com/professional/sites/4/BLPAPI-Core-Developer-Guide.pdf>
7. <https://apidog.com/kr/blog/bloomberg-api-kr/>
8. <https://campusguides.lib.utah.edu/c.php?g=160745&p=1052896>
9. [https://stibee.com/api/v1.0/emails/share/TxoJnC\\_Dok9fAyu7vyPsu5\\_RoWRMhqc=](https://stibee.com/api/v1.0/emails/share/TxoJnC_Dok9fAyu7vyPsu5_RoWRMhqc=)
10. <https://bloomberg.github.io/blrpapi-docs/>
11. <https://forum.numer.ai/t/understanding-bloomberg-tickers/1905>
12. <https://www.bloomberg.co.kr/product/markets-equities/>
13. <https://cran.r-project.org/web/packages/Rblrpapi/vignettes/rblrpapi-intro.html>