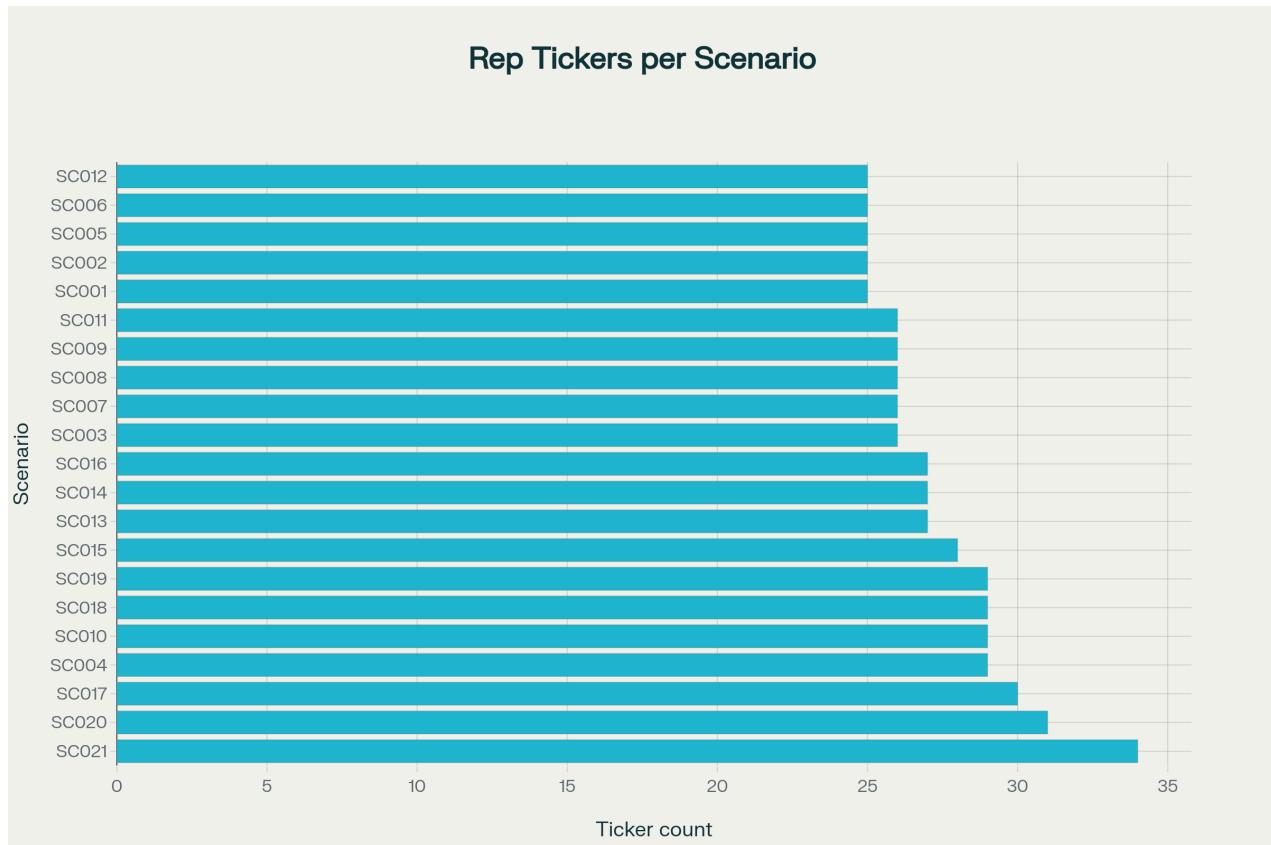


블룸버그 티커 200선과 시나리오 매핑

(Number of Representative Bloomberg Tickers per Scenario)

각 시나리오가 축발할 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.^[1] ^[2] ^[3]. 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 기용 여부를 1차 필터링.
2. [blpapi](#) RefDataService 테스트 스크립트로 가격·거래량·필드 호출 성공을 재확인.
3. 21개 리스크 시나리오(사용자 제시)별로 시장 센티멘트 변동이 즉각 반영되는 ETF·선물·국채지표·개별주를 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 측매 key word	대표 티커 5선 (Bloomberg Ticker)	탐지 포인트
SC001 지정학적 에너지 쇼크	원유·가스 단절	CL1 COMDTY, CO1 COMDTY, NG1 COMDTY, XLE US EQUITY, XOM US EQUITY [4] [2]	원유·가스 현·선물 급등, 에너지 섹터 EPS
SC002 글로벌 상업용 부동산 붕괴	CRE 스트레스	XLRE US EQUITY, VNQ US EQUITY, PLD US EQUITY, SPG US EQUITY, KRE US EQUITY [5] [6]	리츠·오피스·지역은행 동반 하락
SC003 중국 그림자금융 전염	지방채·신용위기	FXI, MCHI, BABA, TCEHY, EWY US EQUITY [7] [8]	A-주·ADR·아시아 ETF 동반 약세
SC004 美 기술주 버블 붕괴	AI 과열	QQQ, XLK, NVDA, AAPL, MSFT [9] [8]	나스닥 100·AI 반도체 고점 조정
SC005 日 YCC 종료 충격	엔화·JGB	EWJ, DXJ, JPYUSD CURNCY, JGBS10 GOVT, TLT [7] [3]	엔화 급등·글로벌 장기채 매도
SC006 美 금리인하 지역·경착륙	소비·둔화	XLY, RTY, AMZN, CAT, HD	소비재·소형주 실적 쇼크
SC007 신흥국 외환위기 재현	달러 강세	DXY CURNCY, UUP, EMB, EEM, ARGT [2] [10]	달러 지수 급등·EM 채권 스프레드
SC008 유럽 에너지 리스크	가스 쇼크	NG1 COMDTY, VGK, SHELL LN, ENGI FP, EWG [11] [12]	TTF 가스·EU 유ти리티 급등
SC009 선진국 국채 위기	고령화·적자	TLT, TBT, BNDX, BWX, TIP	국채 발행 급증·장기금리 급등
SC010 글로벌 이종침체	방어 섹터	XLP, XLU, JNJ, NEE, GLD [4] [2]	필수소비·유ти·골드 상대강세
SC011 글로벌 지정학 리스크 동시화	대만해협	ITA, LMT, VIX INDEX, TSM, CL1 COMDTY	방산·VIX·원유 동반 상승
SC012 고물가·고금리 장기화	스태그플레	TIPS, XLE, DBA, HYG, UUP [3] [11]	물가재·원자재↑·HY 스프레드↑
SC013 中 경기 경착륙	소비붕괴	FXI, YXI, SMH, HG1 COMDTY, EWZ [7] [9]	위안화·구리 가격 급락
SC014 美 기술주 버블 2차 붕괴	ETF 청산	SQQQ, SOXX, META, AMD, TQQQ [9] [8]	레버리지 ETF 감압 매도
SC015 유럽 에너지 쇼크 재현	가스 재급등	FEZ, NG1, TTE FP, ENI IM, EOAN GY [12] [11]	천연가스·EU 제조업 PMI
SC016 신흥국 부채위기 확산	달러부채	PCY, VWOB, TUR, EIDO, HYEM [10] [3]	EM 통화 급락·외채 CDS 확대
SC017 AI 생산성 환상 붕괴	CapEx 부메랑	BOTZ, ROBO, NVDA, PLTR, SNOW	AI ETF 약세·설비투자 취소
SC018 중동 지정학 리스크 확산	호르무즈 위험	XOM, CL1, BDRY, ITA, GLD [2] [11]	유조선 운임·골드·WTI 급등
SC019 ESG-AI 패러독스	녹색·IT 규제	ICLN, KRBN, ESGV, XOM, META [4] [13]	탄소 ETF·재생에너지·빅테크 변동

시나리오 코드	리스크 측매 key word	대표 티커 5선 (Bloomberg Ticker)	탐지 포인트
SC020 디지털 금융 분절	클라우드 다운	CLOU, SKYY, FINX, CIBR, PYPL	클라우드·핀테크· 사이버보안 혼조
SC021 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

b1papi SubscriptionService로 위 200개를 실시간 스트림 → 각 시나리오별 5개 코어 티커를 **Equal-Weighted Basket**으로 컴포지트해 알람을 설정하면 센티멘트 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 = b1p.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 해지 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(Subset)** **구독**을 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_RoWRMhqce
10. <https://bloomberg.github.io/blpapi-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/Rblpapi/vignettes/rblpapi-intro.html>