Packages > Load package > fPortfolio

Arkusz ze stopami zwrotu zapisujemy jako „CSV (rozdzielany przecinkami)”

wyniki=read.csv2("wyniki.csv", header=T)

wczyta się plik z lokalizacji „R working directory” – ścieżkę można sprawdzić wpisując komendę getwd() lub ustawić własną: setwd(”<new path>”)

wynikits=as.timeSeries(wyniki)

Spec = portfolioSpec()  
setTargetReturn(Spec) = mean(colMeans(wyniki)) (lub np. setTargetReturn(Spec) = 0.002)  
Constraints = "LongOnly"

lub np:

Constraints=c("maxW[1:68]=0.3","maxW[1]=0.01") (dla wszystkich zmiennych od pierwszej do 68 maksymalny udział wynosi 30%, dla zmiennej w I kolumnie maksymalny udział 1%)

[1:n] – dla zakresu zmiennych

Dostępne ograniczenia:

– minW, maxW (dolne i górne)

– maxsumW[Asset(s)], minsumW[Asset(s)] – wspólne ograniczenia dla grupy aktywów np. maxsumW[1:3]

Data=wynikits  
efficientPortfolio(Data, Spec, Constraints) (zwraca portfel o min ryzyku i zwrocie setTargetReturn)  
lub

minriskPortfolio(Data, Spec, Constraints )

lub

setNFrontierPoints(Spec) = 150 (ta komenda nie jest wymagana, domyślnie oblicza się 50 pkt)

frontier = portfolioFrontier(Data, Spec, Constraints)

x = frontierPoints(frontier, risk = "Sigma", auto = FALSE)

write.csv2(x,"nazwa")