

Resultado del algoritmo al ejecutarse 30 veces distintas (30 ejecuciones por separado de AG):

BNB	BTC	BCH	ADA	ETG	LTC	XLM	USDT	XRP	EOS	FITNESS
0.1334	0.1095	0.0806	0.1439	0.0578	0.1166	0.0795	0.0989	0.0880	0.0905	0.815155
0.1212	0.1230	0.0892	0.1240	0.1809	0.0296	0.0857	0.1444	0.0853	0.0162	0.976799
0.1095	0.1294	0.1014	0.1277	0.0530	0.1670	0.1594	0.1042	0.0387	0.0092	0.912063
0.0903	0.1051	0.0823	0.0572	0.0655	0.0235	0.1482	0.1639	0.1479	0.1157	0.811785
0.0893	0.2673	0.0183	0.2051	0.1267	0.1238	0.0266	0.0435	0.0887	0.0102	0.912063
0.1095	0.1294	0.1014	0.1277	0.0530	0.1670	0.1594	0.1042	0.0387	0.0092	0.841877
0.0772	0.1898	0.0732	0.2006	0.1371	0.1206	0.0970	0.0031	0.0099	0.0909	0.771028
0.1040	0.1999	0.0292	0.0805	0.1585	0.1474	0.0213	0.1051	0.0101	0.1434	0.923447
0.1749	0.0313	0.1452	0.1447	0.0839	0.0466	0.0292	0.2442	0.0941	0.0053	0.972653
0.0893	0.2673	0.0183	0.2051	0.1267	0.1238	0.0266	0.0435	0.0887	0.0102	0.912063
0.0418	0.2246	0.1074	0.1249	0.1635	0.0415	0.1208	0.1218	0.0438	0.0095	0.967504
0.1749	0.0313	0.1452	0.1447	0.0839	0.0466	0.0292	0.2442	0.0941	0.0053	0.972653
0.1317	0.1605	0.0977	0.0108	0.1492	0.0574	0.0750	0.0523	0.1715	0.0934	0.858559
0.1213	0.0275	0.1909	0.0992	0.1235	0.0058	0.0361	0.1814	0.0575	0.1563	0.839251
0.0455	0.1609	0.0331	0.1878	0.1115	0.0409	0.0418	0.1527	0.1778	0.0475	0.917923
0.0215	0.1715	0.1054	0.1537	0.0586	0.1805	0.0364	0.1243	0.0467	0.1010	0.840236
0.0937	0.2260	0.2058	0.0306	0.0330	0.0090	0.0342	0.2433	0.0822	0.0415	1.075782
0.1635	0.1138	0.0434	0.0574	0.0690	0.0918	0.1794	0.1518	0.0805	0.0489	0.887434
0.1767	0.1013	0.1012	0.0673	0.1629	0.0747	0.1351	0.0608	0.1024	0.0172	0.869678
0.2252	0.0037	0.0248	0.0163	0.1180	0.0997	0.2222	0.1759	0.0373	0.0765	0.852562
0.0993	0.1926	0.0380	0.1598	0.1064	0.0328	0.0524	0.1497	0.1234	0.0451	0.962723
0.0790	0.0067	0.0629	0.1103	0.1553	0.1086	0.0881	0.1019	0.1425	0.1442	0.761827
0.0849	0.2789	0.1756	0.0053	0.0086	0.0288	0.1098	0.1509	0.1086	0.0482	0.926602
0.1528	0.0781	0.1783	0.1178	0.0304	0.1380	0.0097	0.1745	0.0583	0.0617	0.880111
0.0248	0.1303	0.0193	0.1637	0.0374	0.0294	0.0471	0.1992	0.1524	0.1959	0.787914

0.0050	0.0666	0.0513	0.0754	0.1514	0.1306	0.1572	0.1364	0.1769	0.0487	0.762594
0.1206	0.1263	0.0721	0.0149	0.1554	0.2430	0.0646	0.1494	0.0412	0.0119	1.036708
0.0859	0.1607	0.0797	0.0991	0.1345	0.1446	0.0320	0.1455	0.1159	0.0016	1.033627
0.0568	0.0817	0.2103	0.0583	0.1787	0.1361	0.0315	0.1010	0.1279	0.0173	0.881239
0.0501	0.1016	0.1406	0.0375	0.1337	0.1195	0.0977	0.1633	0.0718	0.0839	0.875372

Dentro del problema se explica que:

Después de obtener el frente de soluciones calcule:

$$CV = \frac{E(R_i)}{\delta^2(R_p)}$$

Escoja el máximo valor, obteniendo la mejor cartera.

En este caso el que más tiene es: 1.075782, que corresponde a:

BNB	BTC	BCH	ADA	ETG	LTC	XLM	USDT	XRP	EOS
0.0937	0.2260	0.2058	0.0306	0.0330	0.0090	0.0342	0.2433	0.0822	0.0415