

Métricas básicas

Métricas de contagem

Consistem apenas na contagem de determinado padrão, como por exemplo: contagem de primeiros retornos, total de retornos, etc.

Métricas de posição

- Tendência central
 - Média (mean)
 - Média quadrática (quadratic mean)
 - Média cúbica (cubic mean)
 - Moda (mode)

Consiste no valor que ocorre com maior frequência nos dados.

- Mediana (median)

Elemento que divide uma série ordenada de valores em duas partes de tamanhos iguais.

Nota: a mediana também é considerada uma medida de posição do tipo separatriz.

- Separatrizes
 - Percentis (percentiles)

Percentil é o termo que divide uma série ordenada de valores de acordo com uma proporção de 1 a 100%. Ex: percentil 10, é o valor que separa 10% dos dados abaixo do seu valor e os demais acima. Mediana = percentil 50. Quartil 1 = percentil 25. Quartil 2 = Mediana = percentil 50. Quartil 3 = percentil 75.

Métricas de Dispersão

- Absoluta
 - Mínimo (minimum)

Valor mínimo dos dados. Primeiro valor de uma série ordenada crescente.

- Máximo (maximum)

Valor máximo dos dados. Último valor de uma série ordenada crescente.

- Desvio Quartil (Interquartile distance)

em que $Q = \text{quartil}$

- Desvio Padrão (standard deviation)
- Variância (Variance)
- Desvio médio absoluto (Mean Absolut Deviation)
- Mediana dos desvios absolutos da mediana (Median Absolut deviation from median)
- Mediana dos desvios absolutos da moda (Median absolut deviation from mode)

Métrica de assimetria

- Curtose (Kurtosis)
- Assimetria (Skewness)

Métricas de momento- L

- Primeira ordem
- Segunda ordem

- Terceira ordem
- Quarta ordem

Métricas de proporção

- Relativo aos primeiros retornos
 - Acima de uma altura X
 - Acima da média
 - Acima da moda
- Relativo a todos os retornos
 - Acima de uma altura X
 - Acima da média
 - Acima da moda
- Razão de relevo de copa