



財務指標資料分析

周佳萱

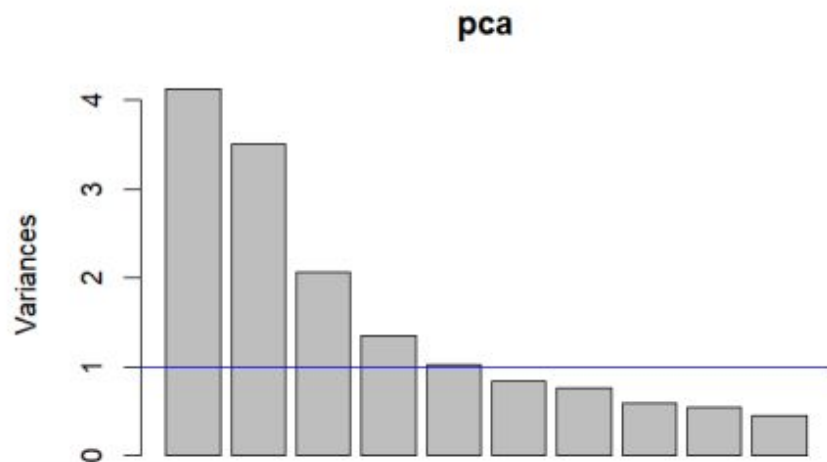
資料介紹

- 資料簡介: 163間公司的財務指標數據。
- 目的: 分析財務報表, 了解公司企業特性, 以降維的方式, 找出有意義的指標, 衡量績優公司。

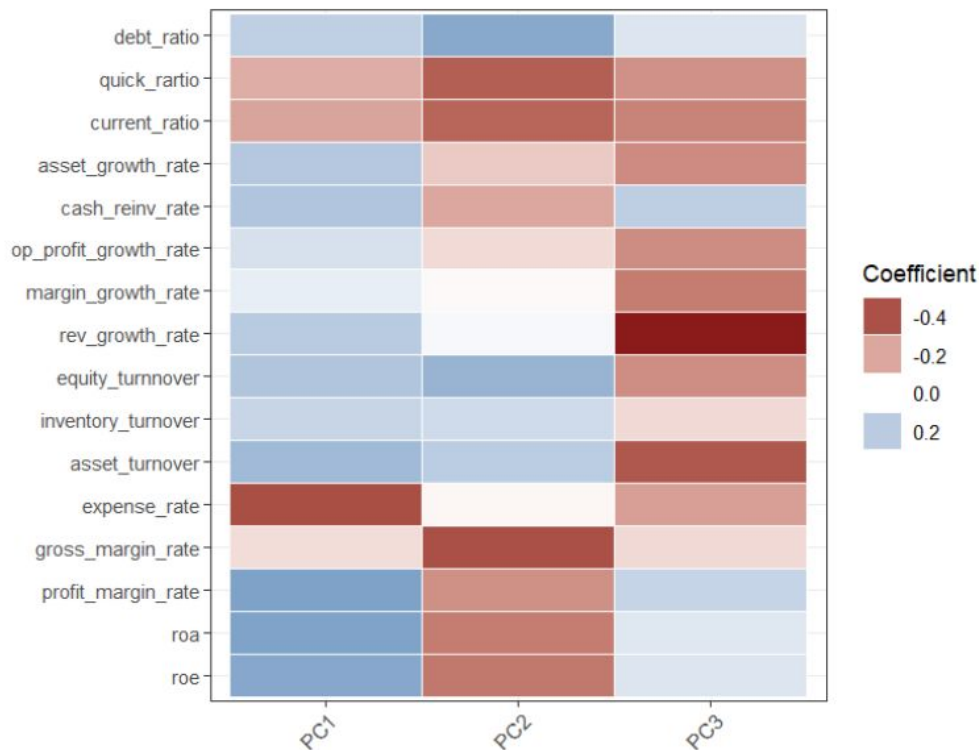


變數選取

- 可以發現前5的主成分的 **VARIANCE** 大於1，所以大約需要5個主成分才能解釋資料。為前三個成分主要解釋資料，因此接下來重點會放在這三個變數上。



主成分解釋



- **PC1 : 公司獲利能力**
- 重點變數: ROE、ROA、profit margin rate、expense rate。
- **PC2 : 公司的財務償還能力**
- 重點變數: gross margin rate、current ratio、quick ratio、debt ratio。
- **PC3 為公司成長能力**
- 重點變數為 revenue growth rate、asset turnover。

公司適合投資股東權益報酬率高、資產報酬率高、營業利益率高、營業費用率低的公司。