Stopy procentowe
$\left(1+\frac{r^{(m)}}{m}\right)^m = 1+r$, więc $r^{(m)} = m[(1+r)^{1/m}-1]$
Stopa efektywna dla stopy nominalnej kapitaliz. m razy w roku: $r_{\mathrm{ef}} = \left(1+\frac{r}{m}\right)^m - 1$.
Dla stopy dyskontowej d równoważną efektywną stopę procentową można obliczyć z równości $\frac{1}{1-d} = 1+r$, skąd $d = \frac{r}{1+r}$ oraz $r = \frac{d}{1-d}$.
$d^{(m)} = m\left(1 - \frac{1}{(1+r)^{\frac{1}{m}}}\right)$
$D_H = W_{\mathrm{nom}}\frac{d}{360}n$ oraz $W_{\mathrm{akt}} = W_{\mathrm{nom}}(1-\frac{d}{360}n)$
Wzór Fishera: $(1+r_{\mathrm{nom}}) = (1+r_{\mathrm{re}})(1+i)$

Wzory dla rent

$$a_{\overline{\infty}|} = \frac{1}{r},\quad \ddot{a}_{\overline{\infty}|} = \frac{1}{d},\quad a^{(m)}_{\overline{\infty}|} = \frac{1}{r^{(m)}},\quad \ddot{a}^{(m)}_{\overline{\infty}|} = \frac{1}{d^{(m)}}$$

$$\ddot{a}_{\overline{n}|} = \frac{1-v^n}{d},\quad a_{\overline{n}|} = \frac{1-v^n}{r},\quad \ddot{a}^{(m)}_{\overline{n}|} = \frac{1-v^n}{d^{(m)}},\quad a^{(m)}_{\overline{n}|} = \frac{1-v^n}{r^{(m)}}.$$

$$\ddot{s}_{\overline{n}|} = \frac{(1+r)^n-1}{d},\ s_{\overline{n}|} = \frac{(1+r)^n-1}{r},\ \ddot{s}^{(m)}_{\overline{n}|} = \frac{(1+r)^n-1}{d^{(m)}},\ s^{(m)}_{\overline{n}|} = \frac{(1+r)^n-1}{r^{(m)}}$$

Wzory dla rat annuitetowych:

$$A = Sq^N\frac{q-1}{q^N-1},\quad S_n = S\frac{q^N-q^n}{q^N-1},\quad Z_n = S_{n-1}r = S\frac{q^N-q^{n-1}}{q^N-1}r$$

Rzeczywista roczna stopa procentowa (rrso) jest ustawowo definiowana jako taka stopa r dla której zachodzi równość

$$\sum_{\alpha=1}^{a} A_\alpha(1+r)^{-t_\alpha} = \sum_{\beta=1}^{b} B_\beta(1+r)^{-t_\beta}$$

gdzie A_α są to płatności dłużnika na rzecz wierzyciela, B_β są to płatności wierzyciela na rzecz dłużnika, t_α, t_β są to momenty płatności.

Inwestycje
$NPV = \sum_{t=1}^{n}\frac{C_t}{(1+r)^t} - I_0$.
Stopa zwrotu (*rate of return, RR*): $R = \left(\frac{FV}{PV}\right)^{\frac{1}{n}} - 1$
IRR jest rozwiązaniem równania $\sum_{i=1}^{n}\frac{C_i}{(1+IRR)^i} = I_0$
$ERR = \left(\frac{1}{I_0}\sum_{i=1}^{n} C_i(1+r)^{n-i}\right)^{\frac{1}{n}} - 1$.
Średni czas trwania D określamy jako $D = \sum_{j=1}^{n} t_j\frac{C_j(1+r^*)^{-t_j}}{I_0}$

- r — stopa dochodu instrumentu, czyli stopa rentowności;
- FV — wartość nominalna (*face value*);
- P — cena instrumentu (*price*);
- N_{im} — liczba dni między terminem emisji a terminem wykupu (*issue to maturity*);
- N_{sm} — liczba dni między terminem sprzedaży a terminem wykupu (*sell to maturity*) (gdy inwestor nie przetrzymuje instrumentu do terminu wykupu);
- N_{pm} — liczba dni między terminem nabycia a terminem wykupu (*purchase to maturity*).

Podstawowa zależność:

$$\left(1+r\frac{N_{pm}}{360}\right)\cdot P = \left(1+i\frac{N_{im}}{360}\right)\cdot FV.$$