

7

Referências Bibliográficas

- ACERBI, C.; TASCHE, D. Expected Shortfall, a natural coherent alternative to Value at Risk. **Economic Notes by Banca Monte dei Paschi di Siena SpA**, v. 31, n.2, p.379-388, 2002.
- ARTZNER, P.; DELBAEN, F.; EBER, J.M.; HEATH, D. **Coherent Measures of Risk**. *Mathematical Finance*, 9(3), p.203-228, 1999.
- CASTRO, J. G. **Otimização da Performance de um Portfólio de Ativos e Opções Reais utilizando a Medida Omega (Ω)**. Tese de Doutorado, DEI, PUC-Rio. Rio de Janeiro: 2008.
- CCEE – Camara de Comercialização de Energia Elétrica, disponível em <http://www.ccee.org.br/cceeinterdsm/v/index.jsp?vnextoid=65daa5c1de88a010VgnVCM100000aa01a8c0RCRD>
- DALBEM, M.; GOMES, L.L. **Tendering System in the Brazilian Wind Sector: valuation and decision, based on the Omega Measure**. 33rd IAEE Meeting. Proceedings. Rio de Janeiro, RJ. Junho 2010.
- FONSECA, R. M. G., **Gerenciamento do Risco Financeiro – Cálculo do Value-At-Risk Utilizando o Modelo Multi-Fatorial Fundamentalista da Barra International**. Tese de Mestrado, DEI, PUC-Rio. Rio de Janeiro: 2000, p.54-57.
- GITMAN, Lawrence J. **Princípios da Administração Financeira**. 7 ed. São Paulo : Harbra, 1997.
- ICK, M.; NOWAK, E. **Omega based Portfólio Optimization – a simulation study on Private Equity investments**. Working Paper, University of Lugano, Switzerland: 2006.
- JORION, P. **Value At Risk: The New Benchmark for Controlling Market Risk**. University of California: 1997.
- J.P.Morgan. **Risk Metrics**. Technical Document, New York, 1996.
- JENSEN, M. The Performance of Mutual funds in the Period 1945-1964, **Journal of Finance**, Vol93, Maio 1968, n.2, p.389-416.

- K. REILLY, F.; A. NORTON, E. **Investimentos**. 7 edição norte americana, 2008.
- KAZEMI, H.; SCHNEEWEIS, T.; GUPTA, R. **Omega as a Performance Measure**. Working Paper CISDM. University of Massachusetts, Isenberg School of Management, 2003.
- KEATING, C.; SHADWICK, W. A Universal Performance Measure. **Jornal of Performance Measurement**, Spring 2002.
_____ **An Introduction to Omega**. The Finance Development Centre, 2002.
- LUZIO, E.F.; MELLIS, C.E.V. **Captação de Investimentos Privados para a Transmissão de Energia Elétrica no Brasil**.
- ANUATTI NETO, F.; MELLO, M.F. **Regulação da infraestrutura no Brasil: casos didáticos**. São Paulo, SP. Editora Singular. 2008.
- MACCLAVE, J.; GEORGE BENSON, P., SINCICH, T. **Statistics For Business and Economics**. 9 edição, 2005.
- MARKOVITZ, H. **Portfólio Selection: efficient diversification of investment**. 2 edição, 1993.
- MARZANO, L. G. **Otimização de Portfólio de Contratos de Energia em Sistemas Hidrotérmicos com Despacho Centralizado**. Tese de Doutorado, DEE, PUC – Rio, 2004.
- PREMIUM SOLVER PLATFORM, **Frontline Systems Inc.**, disponível no site <http://www.solver.com>.
- SHARPE, W. **Portfólio Theory and Capital Markets**. 1 edição, 1970.
- SIMÕES, M. D. P. **Decisão de Sazonalização de Contratos de Fornecimento de Energia Elétrica através da Otimização da Medida Omega**. Dissertação de Mestrado, DAE, PUC-Rio. Rio de Janeiro: 2009.
- TCU - Tribunal de Contas da União, disponível em http://portal2.tcu.gov.br/portal/page/portal/TCU/imprensa/noticias/noticias_arquivos/Apagão.pdf.
- TORRES, R. C., **Avaliação de Portfólios de Contratos de Compra e Venda de Energia Elétrica: Uma Abordagem pela Teoria de Opções**. Dissertação de Mestrado, DEI, PUC-Rio. Rio de Janeiro: 2006.
- TREYNOR, J., How to Rate Management of Investment Funds, **Harvard Business Review**, Vol.43, Jan-Feb 1965, n.1, p. 63-75.

VARGA G, **Índice de Sharpe e Outros Indicadores de Performance Aplicados a Fundos de Ações Brasileiros**. ANPAD - Associação Nacional de Pós-Graduação e Pesquisa em Administração, Curitiba: 2001.

ZANINI, F. A. M., **As Teorias de Carteira de Markovitz e de Sharpe: Uma Aplicação No Mercado Brasileiro de Ações**. Dissertação de Mestrado, DEA, PUC-Rio, São Leopoldo/RS: 2001, p. 34-74.