

10 Referências Bibliográficas

BRANDÃO, L.E.T.; SARAIVA, E.C.G. Garantias Governamentais em Projetos de PPP: Uma Avaliação por Opções Reais. Working Paper, 2007

BATISTA, F.R.S. **Estimação do Valor Incremental do Mercado de Carbono nos Projetos de Fontes Renováveis de Geração de Energia Elétrica no Brasil**: uma abordagem pela teoria das opções reais. Rio de Janeiro, 2007. 199p. Tese de Doutorado. Departamento de Engenharia Industrial, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro

BLACK, F.; SCHOLES, M. The Pricing of Options and Corporate Liabilities, **Journal of Political Economy**, v.81, n.3, p.637-654, mai/jun 1973

BLANK, F.F. **Teoria de Opções Reais Aplicada a Project Finance e Parcerias Público-Privada**. Rio de Janeiro, 2008. 199p. Dissertação de Mestrado. Departamento de Engenharia Industrial, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro

BONOMI, C.A.; MALVESSI, O. **Project Finance no Brasil: Fundamentos e Estudo de Casos**. Editora Atlas, 2002. 396 p.

BORGES, L.F.X.; Faria, V.C.S. Project Finance: Considerações sobre a Aplicação em Infra-estrutura no Brasil. **Revista do BNDES**, v.9, n.18, p. 241-280, dez. 2002

BORGES, L.F.X.; NEVES, C. Parceria Público-Privada: Riscos e Mitigação de Riscos em Operações Estruturadas de Infra-estrutura. **Revista do BNDES**, v.12, n.23, p. 73-118, jun. 2005

BOYLE, P. (1977). **Options: A Monte Carlo Approach**. Journal of Financial Economics, 4, 323-338.

BRANDÃO, L.E.T. **Uma aplicação da Teoria das Opções Reais em Tempo Discreto para Avaliação de uma Concessão Rodoviária no Brasil**. Rio de Janeiro, 2002. 132f. Tese de Doutorado. Departamento de Engenharia Industrial, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro

BRANDÃO, L.E.T.; CURY, M.V.Q. Modelagem Híbrida para Concessões Rodoviárias com o uso da Teoria das Opções Reais: O Caso da Rodovia BR-163. Gestão.Org – **Revista Eletrônica de Gestão Organizacional**, v.4, n.2, mai/ago 2006.

BRANDÃO, L.E.T.; CURY, M.V.Q. Modelagem Híbrida para Concessões Rodoviárias com o uso da Teoria das Opções Reais: O Caso da Rodovia BR-163. Gestão.Org – **Revista Eletrônica de Gestão Organizacional**, v.4, n.2, mai/ago 2006.

BRANDÃO, L.E.T.; SARAIVA, E.C.G. Risco Privado em Infra-estrutura Pública: Uma análise quantitativa de risco como ferramenta de modelagem de contratos. Working Paper, acessado em <http://lynx.iag.puc-rio.br/~brandao/Pesquisa/BR-163%20ANPET%202005%20V3.pdf>, mar. 2008

CHIARA, N.; GARVIN, M.; VECER J. Valuing Simple Multiple-Exercise Real Options in Infrastructure Projects. **Journal of Infrastructure Systems**, v.13, n.2, p.97-104, jun. 2007

COPELAND, Tom E; ANTIKAROV, Vladimir. **Opções Reais: um novo paradigma para reinventar a avaliação de investimentos**. Campus. Rio de Janeiro, 2001.

DIAS, M.A.G. **Opções Reais Híbridas com Aplicação em Petróleo**. Rio de Janeiro, 2005. 509f. Tese de Doutorado. Departamento de Engenharia Industrial, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro

DIXIT, A.; PINDYCK, R. **Investment Under Uncertainty**. Princeton: Princeton University Press, 1994. 468 p.

FARIA, V.C.S. **O Papel do Project Finance no Financiamento de Projetos de Energia Elétrica: caso da UHE Cana Brava**. Rio de Janeiro, 2003. 180p. Tese de Doutorado. Departamento de Engenharia, UFRJ/COPPE.

FINNERTY, John D. **Project Finance: engenharia financeira baseada em ativos**. Qualitymark. Rio de Janeiro, 1999.

FRANCO, Viviane. **Parcerias Público-Privadas no Brasil: em busca da eficiência por meio de alocação de riscos**. São Paulo, 2007. 166p. Dissertação de Mestrado. Departamento de Economia, Pontifícia Universidade Católica de São Paulo.

GARVIN, M.J. *et al.* Valuing Flexibility in Private Toll Road Development: Analysis of the Dulles Greenway. **The Journal of Structured and Project Finance**, winter, n.8331, p. 25-36, 2002

GRANT, D.; VORA, G; WEEKS, D.E. Simulation and the Early-Exercise Option Problem, **The Journal of Finance Engineering**, Vol. 5, no. 3, p.211-227, 1996.

LONGSTAFF, F.A.; SCHWARTZ, E.S. Valuing American options by simulation: A simple least-squares approach. **The Review of Financial Studies**, v.14, n.1, p.113-147, 2001

MERTON, R. (1973). **The Theory of Rational Option Pricing**. Bell Journal of Economics and Management Science, 4, 141-183.

MERTON, R. Theory of Rational Option Pricing, **Bell Journal of Economics and Management Science**, v.4, n.1, p.141-183, 1973

MERTON, R.C. Option Pricing When Underlying Stock Returns Are Discontinuous, **Journal of Financial Economics** 4, 125-144, 1976.

TRIGEORGIS, L. **Real Options – Managerial Flexibility and Strategy in Resource Allocation**. The MIT Press, 1996. 427 p.