

## 7

### Referências Bibliográficas

ALMEIDA, A.; ELLIAN, S; NOBRE, J. **Modificações e alternativas aos testes de Levene e de Brown e Forsythe para igualdade de variâncias e médias.**

Revista Colombiana de Estadística, v.31, no 2 (dez), pp. 241-260, 2008

BARTOLINI, P.; SALAS, J.; OBEYSEKERA, J. T. B. **Multivariate Periodic ARMA(1,1) Processes.** Water Resour. Res. 24(8), 1237-1246, 1988.

BOX, G. E. P.; JENKINS, G. M.; REINSEL, G. C. **Time Series Analysis: forecasting and control.** New Jersey, Prentice Hall, 1994.

CASELLA, G; BERGER, R.L. **Statistical Inference.** Duxbury, 2nd ed., 2001.

CEPEL. **Manual de referência do modelo Newave.** Relatório Técnico, Rio de Janeiro, 2000.

CHARBENEAU, R.J., 1978, **Comparison of the Two- and Three-Parameter Log Normal Distributions Used in Streamflow Synthesis.** Water Resources Research, v. 14, n. 1 (feb), pp. 149-150.

CONOVER, W. U. **Practical Nonparametric Statistics.** John Wiley & Sons, New York, 1971.

EFRON, B.; TIBSHIRANI, R. J. **An Introduction to the Bootstrap.** Chapman & Hall, New York, EUA, 1993.

FINARDI, E. C; GONÇALVES, R. E. C; GARCIA, A. G. N; MATOS, V. L. M.; TAKIGAWA, F. Y. K; ZUCARATO, A. N. **Investigações de propostas metodológicas nos modelos de precificação para minimizar a volatilidade do preço de liquidação de diferenças. Possíveis problemas nos cortes de Benders.** Tractebel Energia, Labplan (UFSC). Florianópolis, Brasil, 2009.

HARVEY, A. C. **Time Series Models.** Philip Allan. London, 1981.

HIPEL, K. W; McLeod, A. I. **Time Series Modelling of Water Resources and Environmental Systems.** Elsevier. Amsterdam, The Netherlands, 1994.

HOSKING, J. R. M. **Modelling Persistence in Hydrological Time Series Using Fractional Differencing.** Water Resource Research, v.20, no.12 (dec), pp. 1898-1908, 1984.

MACEIRA, M. E. P. **Operação Ótima de Reservatórios com Previsão de Afluências.** Dissertação de Mestrado. COPPE/UFRJ, Rio de Janeiro, Brasil. 1989.

MACEIRA, M. E. P.; DAMÁZIO, J. M. **The use of PAR(p) model in the stochastic dual dynamic programming optimization scheme used in the operation planning of the Brazilian hydropower system.** 8th International Conference on Probabilistic Methods Applied to Power Systems, Iowa State University, Ames, Iowa, September 12-16, 2004.

MARCATO, A. L. M. **Representação híbrida de sistemas equivalentes e individualizados para o planejamento da operação de médio prazo de sistemas de potência de grande porte.** Tese de Doutorado, DEE, PUC-Rio, Brasil, 2002.

MATALAS, N. C. **Mathematical Assessment of Synthetic Hydrology.** Water Resource Research, v.3, no.4 (dec), pp. 937-945, 1967.

MENDES, A. G. S. **De la génération de débits synthétiques multivariés par le modèle PARMA multiplicative  $(1,0) \times (1,0)_{12}$** . Université Catholique de Louvain, Faculté des Sciences Appliquées. Grade d'Ingénieur en Hydrologie. Louvain-La-Neuve, Belgium. Nov. 1990.

MONTGOMERY, D. C. **Introdução ao Controle Estatístico da Qualidade**. 4 ed. Rio de Janeiro: Editora LTC, 2004. 513p.

MONTGOMERY, D. C.; RUNGER, G. C. **Estatística Aplicada e Probabilidade para Engenheiros**. 2 ed. Rio de Janeiro: Editora LTC, 2003. 466p.

MORETTIN, P. A.; TOLOI, C. M. C. **Previsão de Séries Temporais**. Atual Editora, São Paulo, 1987.

NETO, A. C. **Bootstrap em séries temporais**. Tese de Doutorado, DEE, PUC-Rio, Brasil, 1991.

NETO, A. C.; SOUZA, R. C. **A Bootstrap Simulation Study in ARMA  $(p,q)$  Structures**. Journal of Forecasting, Vol. 15, n. 4, p. 343-353, 1996.

OBEYSEKERA, J. T. B; SALAS, J. D. **ARMA model identification of hydrologic time series**. Water Resour. Res., 18(4), 1011-1021, 1982.

ONS. Operador Nacional do Sistema Elétrico. Disponível em <<http://www.ons.com.br/home/>>. Acesso em 2009.

OLIVEIRA, F. L. C.; SOUZA, R. C. **Uma nova abordagem para identificação das ordens “p” em modelos autorregressivos periódicos – PAR (p)**. Internal Research Reports, Departamento de Engenharia Elétrica, PUC-Rio. Number 4, dezembro, 2009.

OLIVEIRA, F. L. C.; SOUZA, R. C. **New approach to generating streamflow scenario to long-term energetic operation planning**. ALIO-INFORMS Joint International Meeting, Buenos Aires, 2010.

PEREIRA, M. V. F.; OLIVEIRA, G. C.; COSTA, C. C. G.; KELMAN, J. **Stochastic Streamflow Models for Hydroelectric Systems**. Water Resource Research, v.20, no.3 (mar), pp. 379-390, 1984.

PENNA, D. D. J. **Definição da árvore de cenários de aflúências para o planejamento da operação energética de médio prazo**. Tese de Doutorado, DEE, PUC-Rio, Brasil, 2009.

PONTIFÍCIA UNIVERSIDADE CATÓLICA DO RIO DE JANEIRO. Normas para apresentação de teses e dissertações. Rio de Janeiro: PUC-Rio, 1980.

RASMUSSEN, R. F.; SALAS, J.D.; FAGHERAZZI, L.; RASSAM, J. C.; BOBEE, R. **Estimation and validation of contemporaneous PARMA models for streamflow simulation**. Water Resour. Res. 32(10), 3151-60, 1996.

SALAS, J. D.; BOES, D. C.; SMITH, R. A. **Estimation of ARMA models with seasonal parameters**. Water Resour. Res. 18(4), 1006-10, 1982.

SHAHJAJAN MONDAL, M.; WASIMI, S. A. **Generating and forecasting monthly flows of the Ganges river with PAR model**. Journal of Hydrology. no. 323, pp. 41-46, 2006.

SHESKIN, D. J. **Handbook of parametric and nonparametric statistical procedures**. 3rd. ed., CHAPMAN & HALL/CRC, New York, 2003.

SOUZA, R. C.; CAMARGO, M. E. **Análise e Previsão de Séries Temporais: os modelos ARIMA**. Ijuí: SEDIGRAF, 2004.

STEDINGER, J. R. **Report on the evaluation of CEPEL's PAR models**. Cornell University. School of Civil and Environmental Engineering. Ithaca, New York, 2001.

STEDINGER, J. R.; TAYLOR, M. R. **Synthetic Streamflow Generation: 1. Model Verification and Validation.** Water Resource Research, v.18, n. 4 (aug), pp. 909-918, 1982.

THOMAS, H. A.; FIERING, M. B. **Mathematical synthesis of streamflow sequences for the analysis of river basins by simulation.** Design of Water Resource Systems, edited by A. Mass et al., pp. 459-463, Harvard University Press, Cambridge, Mass., 1962.

TREVISAN, E. S.; SOUZA, L. R.; SOUZA, R. C. **Estimação do parâmetro “d” em modelos ARFIMA.** Pesquisa Operacional, v.20, n. 1 (jun), pp. 73-82, 2000.