

10 Bibliografia

BASTIAN-PINTO, Carlos de Lamare e BRANDÃO, Luiz Eduardo Teixeira. 2009. *Modelagem de Opções Reais com Processos de Reversão à Média em Tempo Discreto: uma aplicação na indústria brasileira de etanol.* Rio de Janeiro : Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro - Departamento de Administração, 2009. Dissertação de Mestrado.

BLACK, Fischer e SCHOLE, Myron. 1973. The Pricing of Options and Corporate Liabilities. [ed.] The University of Chicago Press. *The Journal of Political Economy.* Maio - Junho de 1973, Vol. 81, 3, pp. 637-654.

Centro de Estudos Avançados em Economia Aplicada (CEPEA) da Escola Superior de Agricultura Luiz de Queiroz (ESALQ) da Universidade de São Paulo (USP). [Online] [Citado em: 23 de Outubro de 2010.] www.cepea.esalq.usp.br.

COPELAND, Tom e ANTIKAROV, Vladimir. 2001. *Opções Reais: Um novo paradigma para reinventar a avaliação de investimentos.* [trad.] Maria José Cyhlar. Rio de Janeiro : Editora Campus, 2001.

CORTAZAR, Gonzalo e SCHWARTZ, Eduardo S. 1997. Implementing a Real Option Model for Valuing an Undeveloped Oil Field. *International Transactions in Operational Research.* 1997, Vol. 4, 2, pp. 125-137.

DIAS, Marco Antônio Guimarães. 2010. *Análise de Investimentos com Opções Reais. Notas de Aula do Curso IND2272.* Rio de Janeiro : Departamento de Engenharia Industrial, PUC-Rio, 2010.

DIAS, Marco Antonio Guimarães e ROCHA, Katia Maria Carlos. 1999. Petroleum Concessions With Extendible Options Using Mean Reversion With Jumps To Model Oil Prices. *3rd Annual International Conference on Real Options.* 6-8 de Junho de 1999. Wassenaar/Leiden, Holanda.

DIXIT, Avinash K. e PINDYCK, Robert S. 1994. *Investment under Uncertainty.* Princetown : Princetown University Press, 1994.

2004. *E-Views 5 User's Guide.* Irvine, CA : Quantitative Micro Software, LLC, 2004.

FERRAZ, Rafael de Sequeira Baptista e BAIDYA, Tara Keshar Nanda. 2009. *Estimativa de Preços de Contratos Futuros sobre Petróleo utilizando o Método do Filtro de Kalman*. Rio de Janeiro : Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro - Departamento de Engenharia Industrial, 2009. Dissertação de Mestrado.

HULL, John C. 2001. *Opções, Futuros e Outros Derivativos*. 3ª Edição. São Paulo : Bolsa de Mercadorias e Futuros, 2001.

KULATILAKA, Nalin. 1993. The Value of Flexibility: The Case of a Dual-fuel Industrial Steam Boiler. *Financial Management*. 1993, Vol. 22, 3, pp. 271-279.

MERTON, Robert C. 1976. Option Pricing When Underlying Stock Returns are Discontinuous. *Journal of Financial Economics*. Janeiro-Fevereiro de 1976, Vol. 3, pp. 125-144.

MILANEZ, Artur Yabe, et al. 2010. Logística para o Etanol: Situação Atual e Desafios Futuros. *BNDES Setorial*. Março de 2010, Vol. 31, pp. 49-98.

MILANEZ, Artur Yabe, FAVERET FILHO, Paulo de Sá Campello e ROSA, Sérgio Eduardo Silveira da. 2008. Perspectivas para o Etanol Brasileiro. *BNDES Setorial*. Março de 2008, Vol. 27, pp. 21-38.

Ministério da Agricultura, Pecuária e Abastecimento (MAPA). [Online] [Citado em: 23 de Outubro de 2010.] www.agricultura.gov.br.

MUN, Johnathan. 2002. *Real options analysis : tools and techniques for valuing strategic investments and decisions*. Hoboken : John Wiley & Sons, 2002.

Opções Reais, Análise de Projetos e Financiamentos de Longo Prazo.

RIGOLON, Francisco José Zagari. 1999. Rio de Janeiro : BNDES, Junho de 1999, Revista do BNDES nº11.

PINDYCK, Robert S. e RUBINFELD, D. L. 1991. *Econometric Models and Economic Forecasts*. 3ª Edição. New York : McGraw-Hill, Inc., 1991.

PYNDICK, Robert S. 1999. The Long-Run Evolution of Energy Prices. *The Energy Journal*. 1999, Vol. 20, 2.

ROSA, Sérgio Eduardo Silveira da e GARCIA, Jorge Luiz Faria. 2009. O Etanol de Segunda Geração: Limites e Oportunidades. *Revista do BNDES*. Dezembro de 2009, Vol. 32, pp. 117-156.

SALIBY, Eduardo e MOREIRA, Flávio Filgueiras Pacheco. 2001. *Estudo Comparativo dos Métodos de Quasi-Monte Carlo, Amostragem DEscritiva,*

Hipercubo Latino e Monte Carlo Clássica Análise de Risco. São Paulo : I Encontro Brasileiro de Finanças, 2001.

SCHWARTZ, Eduardo S. e SMITH, James E. 2000. Short -Term Variations and Long-Term Dynamics in Commodity Prices. *Management Science*. Julho de 2000, Vol. 46, 7, pp. 893-911.

SCHWARTZ, Eduardo S. 1997. The Stochastic Behavior of Commodity prices: Implications for Valuation and Hedging. *The Journal of Finance*. Julho de 1997, Vol. 52, 3, pp. 923-973. Papers and Proceedings Fifty-Seventh Annual Meeting, American Finance Association, Janeiro 4-6, 1997 .

—. **1998.** Valuing Long-Term Commodity Assets. *Financial Management*. Primavera de 1998, Vol. 27, 1, pp. 57-66.

SHIMKO, David C. 1992. *Finance in Continuous Time - A Primer*. EUA : Kolb Publishing Company, 1992.

TRIGEORGIS, Lenos. 1996. *Real Options: Managerial Flexibility and Strategy in Resource Allocation*. Cambridge : The MIT Press, 1996.

União da Indústria da Cana-de-Açúcar (Única). [Online] [Citado em: 23 de Outubro de 2010.] www.unica.com.br.