

## 7

### Referência Bibliográfica

ACERBI, C.; TASCHE, D. Expected Shortfall: a natural coherent alternative to Value at Risk. **Bank for international Settlements**, 2001, disponível em <http://www.bis.org/bcbs/ca/acertasc.pdf>, acessado em 01/02/2012 às 20:00.

\_\_\_\_\_. On the coherence of expected shortfall. **Journal of Bank & Finance**, v.26, p. 1487-1503, 2002.

ASSAF NETO, A. **Mercado Financeiro**. 8. ed. São Paulo: Editora Atlas, 2009.

CÂMARA DE COMERCIALIZAÇÃO DE ENERGIA ELÉTRICA, [www.ccee.org.br](http://www.ccee.org.br), acessado em 01/03/2012 às 21:00.

CASCON, A.; KEATING, C.; SHADWICH, W. The Omega Function. The **Finance Develop Centre. London**, final revision, Mar. 2003.

CASTRO, J. G., **Otimização da performance de um portfólio de ativos e opções reais utilizando a medida Ômega**. Departamento de Engenharia Industrial, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, Tese de Doutorado, 2008.

COOPERS e LYBRAND. **Projeto de reestruturação do setor elétrico brasileiro**: relatório consolidado - etapa VII, MME/SEN/ELETOBRÁS, 1997.

ELETOBRAS, Relatório de sustentabilidade 2010, [www.eletobras.com](http://www.eletobras.com)

GITMAN, L. J. **Princípios da Administração Financeira**. 10.ed. São Paulo: Pearson, 2004.

GOMES, L.L.; BRANDÃO, L.E.; PINTO, A.C.F. **Otimização de carteiras de energia elétrica através da medida Ômega**. Revista Brasileira de Finanças, v. 8 n. 1, 2010.

ICK, M., NOWAK, E., Omega Based Portfolio Optimization – A Simulation Study on Private Equity Investments. **Working Paper University of Lugano**, Switzerland, 2006.

JORION, P. **Value At Risk**. 2.ed. São Paulo: Bm&f, 2003.

JP MORGAN, **Risk Metrics**. Technical Document, New York, 1996.

KAZEMI, H., SCHNEEWEIS, T., GUPTA, R. Omega as a Performance Measure. **Working Paper CISDM. Isenberg School of Management**, University of Massachusetts, 2003.

KEATING, C., SHADWICK, W. A Universal Performance Measure. **Journal of Performance Measurement**, Spring: p. 59-84, 2002.

MARZANO, L.G. **Otimização de Portfólio de Contratos de Energia em Sistemas Hidrotérmicos com Despacho Centralizado**. Tese de Doutorado, DEE, PUC – Rio, 2004.

OPERADOR NACIONAL DO SISTEMA ELÉTRICO, [www.ons.org.br](http://www.ons.org.br), acessado em 18/01/2012 às 20:00.

PAGNANI, E. M.; OLIVIERI, F. J. **Instrumentos de Avaliação de Desempenho e Risco no Mercado Acionário brasileiro**: um estudo de Anomalias de Mercado na Bolsa de Valores de São Paulo. Revista Brasileira de Gestão em Negócios, Ano 6, N 6, 2004. Disponível em <http://200.169.97.104/seer/index.php/RBGN/article/viewFile/26/24>, acessado em 20/01/2012 às 21:30.

ROSS, S. A.; WESTERFIELD, R. W., JAFFE, J. F. **Administração Financeira: corporate finance**. 8.ed. São Paulo: Atlas, 2007.

SCHOUCHANA, F. S., **Decisão Ótima em Swaps de Energia Elétrica no Brasil Utilizando a Medida Ômega**. Dissertação de Mestrado, DAE, PUC-Rio, 2010.

SIMÕES, M. D. P., **Decisão de Sazonalidade de contratos de Fornecimento de Energia Elétrica Através da Otimização da Medida Ômega**. Dissertação de Mestrado, DAE, PUC-Rio, 2009.

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, 2006.

VAN HORNE, J. **Fundamentos de Administração Financeira**, Rio de Janeiro: Prentice Hall do Brasil, 2002