

## 7

### BIBLIOGRAFIA

BARROSO, Luiz Augusto N. **Esquemas Competitivos em Sistemas Hidrotérmicos: Comportamento Estratégico de Agentes Geradores em Ambiente de Mercado**. Monografia (Tese M.Sc.), IM-NCE/UFRJ, 2000

BARROSO, Luiz Augusto N.; KELMAN, Rafael; PEREIRA, Mário V.F. Market Power Assessment and Mitigation in Hydrothermal Systems. IEEE Transactions on Power Systems, Vol.16, N.3, Aug.2001, pp.354-359

BARROSO, Luiz Augusto N.; GRANVILLE, Sergio; TRINKREICH, Jorge; PEREIRA, Mário V.F.; LINO, Priscila. Avaliação de Estratégias de Redução de Risco Hidrológico para Empresas com Portfolios Predominantemente Hidroelétricos. XVII SNPTEE, GAE-12, Out. 2003

BAZARAA, Mokthar S.; JARVIS, John J. **Linear Programming and Network Flows**. John Wiley, 1977. ISBN 0471060151

BERTSEKAS, Dimitri P. **Dynamic Programming and Stochastic Control**. Academic Press, 1976. ISBN 0120932504

BESSEMBINDER, Hendrik; LEMMON, Michael L. Equilibrium Pricing and Optimal Hedging in Electricity Forward Markets. Journal of Finance, Jun.2002

BIRGE, John R.; LOUVEAUX, François. **Introduction to Stochastic Programming**. Springer-Verlag, 1997. ISBN 0387982175

BITU, Roberto S.; BORN, Paulo H. **Tarifas de Energia Elétrica – Aspectos Conceituais e Metodológicos**. MM Editora, 1993. não indexado

BLACK, Fischer; SCHOLLES, Myron. The Pricing of Options and Corporate Liabilities. *Journal of Political Economy*, n.81, May/June 1973, pp. 637-659

BRADLEY, Stephen P.; HAX, Arnaldo C.; MAGNANTI, Thomas L. **Applied Mathematical Programming**. Addison-Wesley, 1977. ISBN 020100464X

BREALEY, Richard A.; MYERS, Stewart C. **Principles of Corporate Finance**. Mc Graw-Hill, 1996. ISBN 0070074178

CASTRO, Alessandro L. **Avaliação de Investimento de Capital em Projetos de Geração Termoeletrica no Setor Elétrico Brasileiro usando Teoria das Opções Reais**. Monografia (Tese M.Sc.), PUC-Rio, 2000

CASTRO, Roberto; LYRA F<sup>o</sup>, Christiano. Um Método para Estimativa do Preço da Energia no Mercado Atacadista num Horizonte de Médio Prazo. XVII SNTPEE, GAE-11, 2003.

DAVID, Pedro A. M-S.; MOREIRA, Ajax R.B.; ROCHA, Katia. Attraction of Investments in Power Generation and the Brazilian Regulatory Framework. VIII SEPOPE, Oct.2002

DIXIT, Avinash K.; PINDYCK, Robert S. **Investment Under Uncertainty**. Princenton Univ. Press, 1994. ISBN 0691034109

EKENBERG, Love. Survey of Decision Analysis. Working Paper, DSV – Stockholm Univ., 2000

ELTON, Edwin J.; GRUBER, Martin J. **Modern Portfolio Theory and Investment Analysis**. John Wiley, 1995. ISBN 0471007439

FORTUNATO, L.A.M.; ARARIPE Neto, T.A.; ALBUQUERQUE, J.C.R.; PEREIRA, M.V.F. **Introdução ao Planejamento da Expansão e da Operação de Sistemas de Produção de Energia Elétrica**. Ed.Universitária UFF, 1990

GOMES, Leonardo L. **Avaliação de Termelétricas no Brasil Estudando o Melhor Momento de Investimento por Modelos de Opções Reais**. Monografia (Tese D.Sc.), PUC-Rio, 2002

HENDERSON, James M.; QUANDT, Richard E. **Microeconomic Theory – A Mathematical Approach**. McGraw Hill - Kogakusha, 1971.

HILLIER, Frederick S.; LIEBERMAN, Gerald J. **Introduction to Operations Research**. McGraw Hill, 2001 (7<sup>th</sup> Ed.) ISBN 0072535105

HUANG, Chi-Fu; LITZENBERGER, Robert H. **Foundations for Financial Economics**. Prentice Hall, 1998. ISBN 0135006538

HULL, John C. **Options, Futures and Other Derivatives**. Prentice Hall, 1997 (3<sup>rd</sup> Ed.). ISBN 0131864793

JORION, Philippe. **Value at Risk: The New Benchmark for Controlling Market Risk**. McGraw Hill, 1997. ISBN 0786308486

- KELMAN, Rafael. **Esquemas Competitivos em Sistemas Hidrotérmicos: Eficiência Econômica e Comportamento Estratégico**. Monografia (Tese M.Sc.), COPPE/UFRJ, 1999
- KLIGERMAN, Alberto S. **Avaliação da Instabilidade do Preço do Mercado de Energia Elétrica Obtido A Partir do Custo Marginal de Curto Prazo**. Monografia (MBA). Instituto Economia/UFRJ, 1999
- LINO, Priscila R. **Esquemas Competitivos em Sistemas Hidrotérmicos: Operação Descentralizada de Sistemas Hidrotérmicos em Ambiente de Mercado**. Monografia (Tese M.Sc.), IM-NCE/UFRJ, 2001
- MAE - Mercado Atacadista de Energia. **Síntese das Regras de Mercado**. Apostila, 2000. [www.mae.org.br](http://www.mae.org.br)
- MARKOWITZ, Harry. **Portfolio Selection: Efficient Diversification of Investments**. John Wiley, 1959.
- MAS-COLELL, Andreu, WHINSTON, Michael D., GREEN, Jerry R. **Microeconomic Theory**. Oxford University Press, 1995. ISBN 0195073401
- MME - Min. Minas e Energia. **Plano Decenal de Expansão 2003 – 2012: Sumário Executivo**. Rel. Técnico, MME (CCPE), Jan. 2003
- MO, Birger; GJELSVIK, Anders; GRUNDT, Asbjørn; KÅRENSEN, Kjetil. **Optimisation of Hydropower Operation with Focus on Price Modelling**. Porto Power Tech, Sept. 2001
- MO, Birger; GJELSVIK, Anders. **Simultaneous Optimisation of Withdrawal from a Flexible Contract and Financial Hedging**. 14<sup>th</sup> PSCC, June 2002
- MOREIRA, Ajax R.B.; ROCHA, Katia; DAVID, Pedro A. M-S. **Thermopower Generation Role in the Brazilian Power System Operation and Expansion**. Working Paper IPEA TD-0823/2001, 2001
- MOREIRA, Ajax R.B.; ROCHA, Katia; DAVID, Pedro A. M-S. **Thermopower Generation Investment in Brazil – Economic Conditions**. Energy Policy (Elsevier Science), v.32, 2004, pp.91-100
- von NEUMANN, John; MORGENSTERN, Oskar. **Theory of Games and Economic Behaviour**. Princeton Press, 1947. ISBN 0691003629
- NORDPOOL. **Elspot – The Spot Market**. Relatório Técnico. Out. 1998. [www.nordpool.com](http://www.nordpool.com)
- NORDPOOL. **Eltermin – The Financial Market**. Relatório Técnico. Out. 1998. [www.nordpool.com](http://www.nordpool.com)
- OLIVEIRA, Adilson; PINTO Jr., Helder Q. **Financiamento do Setor Elétrico Brasileiro**. Ed. Garamond, 1998; ISBN 8586435120
- OLIVEIRA, Adilson. **Reforming the Power Industry – The Brazilian Experience**. Draft Paper. Aug. 2003

- PEREIRA, Mário Veiga F.; PINTO, Leontina M. V. G. Stochastic Optimization of a Multireservoir Hydroelectric System: A Decomposition Approach. *Water Resources Research*, v.21, n.6, pp.779-792, June 1985
- PEREIRA, Mário Veiga F. Optimal Stochastic Operations Scheduling of Large Hydroelectric Systems. *Electrical Power & Energy Systems*. v.11, n.3, pp.161-169, Jul.1989
- PEREIRA, Mário V.F. Overview of Brazilian Regulatory Framework. Tech. Report 39/98, PSR Consultoria, 1998(a)
- PEREIRA, Mário V.F.; CAMPODÓNICO, Nora; KELMAN, Rafael. Long Term Hydro Scheduling Based on Stochastic Models. *EPSOM*, 1998(b)
- PEREIRA, Mário V.F.; CAMPODÓNICO, Nora; KELMAN, Rafael; GRANVILLE, Sérgio. Planning Risks. *EPSOM'98*, 1998(c)
- PEREIRA, Mário V.F.; CAMPODÓNICO, Nora; KELMAN, Rafael. Application of Stochastic Dual DP and Extensions to Hydrothermal Scheduling. Tech. Report 12/99, PSR Consultoria, 1999
- PEREIRA, Mário V.F.; CAMPODÓNICO, Nora; KELMAN, Rafael; GRANVILLE, Sergio. Planning Risks - Tutorial Course. *IEEE Power Industry Computer Applications*, 1999
- PEREIRA, Mário V.F. *et al.* Methods and Tools for Contracting in a Competitive Framework. *CIGRÉ Report TF38-05-09*, 2000
- PILIPOVIC, Dragana. **Energy Risk**. McGraw Hill, 1997. ISBN 0786312319
- PINDYCK, Robert S. Volatility and Commodity Price Dynamics. MIT/CEEPR Working Paper, 2001(a). [web.mit.edu/ceepr/www/](http://web.mit.edu/ceepr/www/)
- ROSA, Luiz Pinguelli; TOLMASQUIM, Maurício T.; PIRES, José Claudio L. **A Reforma do Setor Elétrico no Brasil e no Mundo: Uma Visão Crítica**. Relume Dumará – COPPE/UFRJ, 1998. ISBN 8573116-1493
- PRATT, John W. Risk Aversion in the Small and in the Large. *Econometrica*, v.32, n.1-2, Jan.-Apr.1964, pp.122-130
- PINDYCK Robert S. Volatility and Commodity Price Dynamics. MIT/CEEPR Working Paper, 2001(a). [web.mit.edu/ceepr/www/](http://web.mit.edu/ceepr/www/)
- PINDYCK Robert S. The Dynamics of Commodity Spot and Futures Markets: A Primer. MIT/CEEPR Working Paper, 2001(b). [web.mit.edu/ceepr/www/](http://web.mit.edu/ceepr/www/)
- SARGENT, Thomas J. **Macroeconomic Theory**. Academic Press, 1987. ISBN 0126197512
- SCHWARTZ, Eduardo S. The Stochastic Behavior of Commodity Prices: Implications for Valuation and Hedging; *Journal of Finance*, v.52, n.3, July 1997, pp.923-973

da SILVA, Edson Luiz. **Formação de Preços em Mercados de Energia Elétrica**. Ed. Sagra Luzzatto, 2001. ISBN 85241064468

SOARES, Neyl H.M. *et al.* Proposta de Serviços Ancilares para o Sistema Interligado Nacional. VII EDAO, 2002

TEIXEIRA, M. A. **Mercados Futuros – Fundamentos e Características Operacionais**. BM&F, 1992. não indexado

TERRY, Leslie A. Custo Explícito de Déficit de Energia Elétrica. Nota Técnica DPP/POG-991/97, CEPEL, Julho 1998(a)

TERRY, Leslie A. O Mercado Atacadista de Energia (MAE) e os Custos Marginais da Energia Elétrica. Nota Técnica Interna, CEPEL, 1998(b)

VARIAN, Hal. **Microeconomic Analysis**. W.W.Norton, 1992. ISBN 0393957357

WONNACOTT, Thomas H.; WONNACOTT, Ronald J. **Introductory Statistics**. John Wiley & Sons, 1990. ISBN 047151733X