

7

Referências Bibliográficas

- [1] Black, F; Scholes, M, The Pricing of Corporate Liabilities, Journal of Political Economy, 81(May-June 1973), p. 637-659.
- [2] Merton, Robert C. Theory of Rational Option Pricing. Bell Journal of Economics and Management Science 4 (spring 1973).
- [3] Barone-Adesi, G., Whaley, R. E., Efficient Analytic Approximation of American Option Values, The Journal of Finance, Vol XLII, Nº 2, June 1987.
- [4] Geske, R., H. E. Johnson, The American Put Valued Analytically, Journal of Finance, Vol 39, Nº 5, December 1984.
- [5] Dias, Marco A. G., Investimento Sob Incerteza em Exploração & Produção de Petróleo, Dissertação de Mestrado, Departamento de Engenharia Industrial, PUC-RIO, 1996.
- [6] Dixit, A. K.; Pindyck R. S., Investment under Uncertainty, Princeton University Press, Princeton, N.J., 1994.
- [7] Hull, J. C., Options, Futures, & Other Derivatives, Prentice Hall, Englewood Cliffs, NJ, 4th ed. 1999, 698 pp.
- [8] Dias, Marco Antonio G., Investment in Information for Oil Field Development Using Evolutionary Approach with Monte Carlo Simulation, 5th Annual International Conference on Real Options - Theory Meets Practice, UCLA, Los Angeles, USA, July 13-14, 2001.
- [9] Mean Reversion Models. Disponível em <http://www.puc-rio.br/marco.ind/revers.html#mean-rev>. Último acesso em 13 de Agosto de 2004.
- [10] Bhattacharya, Suddipto. Project Valuation with Mean Reversion Cash Flow Streams. The Journal of Finance, Vol. 33, No. 5, (Dec., 1978), pp. 1317-1331.
- [11] Sarkar, S., Zapatero, F., The Trade-off Model with Mean Reverting Earnings: Theory and Empirical Tests, The Economic Journal, 113, October 2003, p. 834-860, Royal Economic Society.
- [12] Batista, F.R.S., Avaliação de Opções de Investimento em Projetos de Exploração e Produção de Petróleo por meio da Fronteira de Exercício Ótimo da

Opção., Rio de Janeiro, 2002, 110 pp. Dissertação de Mestrado (Engenharia Industrial)-Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro.

[13] Koza, J. R., Genetic Programming: On the Programming of Computers by Means of Natural Selection, MIT Press, Cambridge, MA, USA, 1992.

[14] Koza, J. R., Genetic Programming II: Automatic Discovery of Reusable Programs, MIT Press, Cambridge, MA, USA, 1994.

[15] Programação Genética. Disponível em <http://www.ica.ele.puc-rio.br/cursos/download/CE-ga9.pdf>. Último acesso em 9 de dezembro de 2003.

Programs, MIT Press, Cambridge, MA, USA, 1994.

[16] W. Banzhaf, P. Nordin, R. Keller and F. Francone Academic Press / Morgan Kaufmann, San Francisco, CA, 1998 (3rd corr. ed., 2001).

[17] Davis, L., Handbook of genetic algorithms, Van Nostrand Reinhold, New York, New York, USA, 1991.

[18] Montana, David J., Strongly Typed Genetic Programming, BBN Technical Report #7866, Cambridge, MA, 1993.

[19] Stroustrup, B. C++ A Linguagem de Programação 823pp., Porto Alegre, Brasil, 2000.

[20] Lenaerts, Tom; Manderick, Bernard, Building a Genetic Programming Framework: The Added-Value of Design Patterns. Proceedings of the First European Workshop on Genetic Programming, LNCS, Vol. 1391, pp. 196-208, Springer-Verlag, 14-15 April 1998.

[21] E. Gamma, R. Helm, R. Johnson, and J. Vlissides. Design Patterns: Elements of Reusable Object-Oriented Software. Addison-Wesley, Reading, MA, USA, 1994.

[22] Frota, A. F., Avaliação de Opções Americanas Tradicionais e Complexas, Rio de Janeiro, 2003, 143 pp. Dissertação de Mestrado (Engenharia Industrial)-Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro.

[23] Gagné C., Parizeau, M., Open BEAGLE Manual em http://easynews.dl.sourceforge.net/sourceforge/beagle/beagle-manual-2_1_3-r1.pdf 80pp. April, 2004. Último acesso em 28 de julho de 2004.

[24] Monte Carlo Simulation of Stochastic Processes. Disponível em http://sphere.rdc.puc-rio.br/marco.ind/sim_stoc_proc.html#mc-mrd. Último acesso em 13 de agosto de 2004.

[25] Análise de Alternativas de Desenvolvimento de um Campo sob condições de Incerteza de Mercado: Alternativas de Investimento por Diferenças Finitas: PETROBRÁS – Petróleo Brasileiro S.A., 2001: 1 disquete.