

- [1] AIRES, João Carlos de Oliveira. **Competição em sistemas de energia elétrica: comercialização e estratégias para o mercado**. Tese Doutorado – Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, 2001.
- [2] CCEE – Câmara de Comercialização de Energia Elétrica: site www.ccee.org.br consultado em 10/04/2006.
- [3] LEI nº 9648, de 27 de maio de 1998.
- [4] LEI nº 9427, de 26 de dezembro de 1996.
- [5] ANEEL – Agência Nacional de Energia Elétrica: site www.aneel.gov.br consultado em 10/04/2006.
- [6] Decreto Presidencial nº 5163, de 30 de julho de 2004.
- [7] MARKOWITZ, Harry. **Portfolio Selection: efficient diversification of investment**. 2nd Ed. USA, Basil Blackwell Inc, 1991.
- [8] MARKOWITZ, Harry. Portfolio Selection. **Journal of Finance**, USA, V. VII, n.1, p. 77-91, mar. 1952.
- [9] SCHAERF, Andrea. Local Search Techniques for Constrained Portfolio Selection Problems. **Computational Economics**, Netherlands, n.20, p.177-190, 2002.
- [10] AWERBUCH, Shimon; BERGER, Martin. **Applying Portfolio Theory to EU Electricity Planning and Policy-Making**. Relatório da *International Energy Agency* (IEA), Paris, Fev. 2003.

- [11] SIERKSMA, Gerard. **Linear and Integer Programming: theory and practice**. 2nd Ed. USA, Marcel Dekker Inc, 2002.
- [12] TITUS JUNIOR, Martin E; LEWIS, Donald. Introduction, In: **Understanding and Applying Value-at-Risk**. London, Risk Publications, 1997. p. 19-21.
- [13] JORION, Philippe. **Value at Risk: the new benchmark for controlling market risk**. USA, McGraw-Hill, 1997.
- [14] REED, Nick. Variations on a Theme. In: **Understanding and Applying Value-at-Risk**. London, Risk Publications, 1997. p. 23-26.
- [15] SMITHSON, Charles; MINTON, Lyle. How to Calculate VAR. In: **Understanding and Applying Value-at-Risk**. London, Risk Publications, 1997. p. 27-30.