

Bibliografia

- [1] Agência Nacional de Energia Elétrica (ANEEL) - Disponível em: www.aneel.gov.br.
- [2] Aguiar, E. Análise Básica de Operação do Gerador de Dupla Alimentação para Aproveitamento Eólico. 2007. Dissertação (Mestrado em Engenharia Elétrica) – Universidade Federal do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, 2007.
- [3] Amarante et al. Complementaridade Sazonal dos Regimes Hidrológico e Eólico no Brasil. DEWI Magazin Nr. 19, August 2001. pag 79-86.
- [4] Amarante. Atlas do Potencial Eólico Brasileiro. MME. 1ª edição. 2001.
- [5] Amenedo et al. Sistemas eólicos de producción de energia eléctrica. Madrid: Rueda, 2003. p. 97-179.
- [6] ANEEL. Atlas de Energia Elétrica no Brasil. Brasília.ANEEL. 2ª edição.2005.
- [7] ANEEL. Atlas de Energia Elétrica no Brasil. Brasília.ANEEL. 3ª edição.2008.
- [8] ANEEL. Resolução n. 652, de 09 de dezembro de 2003.
- [9] Artzner, P.; Delbaen, P.; Eber, J.; Heath, D. Coherent measures of risk. Math Finance, v. 9, n. 3, p.203-228, 1999.
- [10] Barroso, L.A.; Pereira, M. V.; Kelman, R. Market Power Assessment and Mitigation in Hydrothermal Systems – IEEE Transactions on Power Systems Vol. 16, No 3, August 2001, Pages 354 – 359.
- [11] Barroso, L. A.; Rosenblatt, J.; Bezerra, B.; Resende, A.; and Pereira, M. “Auctions of contracts and energy call options to ensure supply adequacy in the second stage of the Brazilian power sector reform,” in Proc. 2006 IEEE PES General Meeting, Montreal, QC, Canada.
- [12] Barroso, L. A.; Lino, P.; Ralston, F.; Porrua, F. and Bezerra, B. “Cheap and clean energy: Can Brazil get away with that?,” in Proc. 2008 IEEE PES General Meeting, Tampa, FL.

- [13] Birge, J. R. and Louveaux, F. Introduction to Stochastic Programming, Springer, 2000.
- [14] Bortolossi, H.J. and Pagnoncelli, B.K. Uma Introdução à Otimização sob Incerteza, Universidade Federal de Goiás: III Bienal da Sociedade Brasileira de Matemática, 2006.
- [15] Birge, J.R. and Louveaux, F. Introduction to Stochastic Programming, Springer, 2000.
- [16] Câmara de Comercialização de Energia Elétrica (CCEE) – Disponível em: www.ccee.org.br.
- [17] Carrión, M.; Conejo, A. J.; Arroyo, J. M.; “Forward Contracting and Selling Price Determination for a Retailer”, IEEE Trans. Power Syst., vol. 22, no. 4, Nov.2007.
- [18] Carrión, M.; Conejo, A. J.; García-Bertrand, R.; “Optimal Involvement in Forward Markets of a Power Producer”, IEEE Trans. Power Syst., vol. 23, no. 2, May 2008.
- [19] Costa et al. Um Panorama da Indústria de Bens de Capital Relacionados à Energia Eólica. BNDES. 2009.
- [20] Dalmaç, A. Estudo do Potencial Eólico e Previsão de Ventos para Geração de Eletricidade em Santa Catarina. 2007. Dissertação (Mestrado em Engenharia Mecânica) – Universidade Federal de Santa Catarina, Florianópolis, 2007.
- [21] Durães, M. S. D. Teoria dos Leilões: Abordagem Comparativa com Ênfase nos Leilões de Títulos do Tesouro no Brasil e em Outros Países. Brasília-DF: Tesouro Nacional, 1997.
- [22] Ellsberg, D.; “Risk, Ambiguity and Savage Axioms”, Quarterly Journal of Economics, 75, 1961.
- [23] Empresa de Pesquisa Energética (EPE) - Disponível em: www.epe.gov.br
- [24] Energy Information Administration (EIA) - Disponível em: www.eia.doe.gov.
- [25] EPE. Estudos para a Licitação da Expansão da Geração - Garantia Física dos Empreendimentos Termelétricos e Pequenas Centrais Hidrelétricas do

- Leilão de Compra de Energia Nova - A-5 de 2008. n. EPE-DEE-RE-064/2008-r1, de 23 de abril de 2008.
- [26] European Wind Energy Association (EWEA) – Disponível em: www.ewea.org.
- [27] Fonseca, F. Estratégias de Sazonalização da Garantia Física de PCHs em Portfolios PCH e Biomassa. 2009. Dissertação (Mestrado em Engenharia Elétrica). Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, 2009.
- [28] Garcia, A. Leilão de Eficiência Energética no Brasil. 2008. Tese (Doutorado em Engenharia Elétrica) – Universidade Federal do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, 2008.
- [29] García-González, J.; de la Muela, R. M. R.; Santos, L. M. and Gonzalez, A. M. “Stochastic joint optimization of wind generation and pumped storage units in an electricity market,” IEEE Trans. Power Syst., vol. 23, no. 2, pp. 460–468, May 2008.
- [30] JP Morgan, “Risk Metrics”, Technical Document, 4^a edition, New York, NY, 1996.
- [31] Krohn, S. Wind Energy Reference Manual, Dinamarca, 2003.
- [32] Markowitz, H. M. Portfolio selection. Journal of Finance, v. 7, n. 1, p.77-91, 1952.
- [33] Marzano, L. G. B. Otimização de Portfolio de Contratos de Energia em Sistemas Hidrotérmicos com Despacho Centralizado. Tese (Doutorado em Engenharia Elétrica). Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, 2004.
- [34] Operador Nacional do Sistema Elétrico (ONS) – Disponível em: www.ons.org.br.
- [35] Pagnincelli, B.; Sample Average Approximation for Chance Constrained Programming. 2009. Tese (Doutorado em Matemática). Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, 2009.
- [36] Palmquist, J.; Uryasev, S.; Krokmal, P. Portfolio optimization with Conditional Value-at-Risk objective and constraints. Research Report 99-14. ISE Dept., University of Florida, 1999.

- [37] Pereira, M.; Barroso, L. A. and Rosenblatt, J. “Supply adequacy in the Brazilian power market” Proceedings of the IEEE General Meeting, Denver, 2004 – Available at <http://www.psr-inc.com>.
- [38] Portal PCH – Disponível em: www.portalpch.com.br.
- [39] PSR Consultoria. Disponível em <http://www.psr-inc.com>.
- [40] Rockafellar, R. T.; Uryasev, S. Optimization of conditional value-at-risk. *The Journal of Risk*, v. 2, n. 3, p.21-41, 2000.
- [41] Rockafellar, R. T.; Uryasev, S. Conditional value-at-risk for general loss distributions. *Journal of Banking and Finance*, v. 26, p.1443-1471, 2002.
- [42] Schultz; Rocha et al. Sistemas Complementares de Energia Eólica e Hidráulica no Brasil. *Espaco Energia*, n. 3, outubro 2005, Brasil.
- [43] Silva et al. The utilization of Wind energy in the Brazilian electric sector’s expansion. *Renewable and Sustainable energy reviews*. v. 9, p.289-309, setembro 2005.
- [44] Street, A. “Estratégia de Oferta de Geradoras em Leilões de Contratação de Energia Elétrica”. Rio de Janeiro, 2004, 103p. Dissertação de Mestrado – Departamento de Engenharia Elétrica, Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro (PUC-Rio).
- [45] Street, A. Equivalente Certo e Medidas de Risco em Decisões de Comercialização de Energia Elétrica. 2008. Tese (Doutorado em Engenharia Elétrica). Pontifícia Universidade Católica do Rio de Janeiro, Rio de Janeiro, 2008.
- [46] Street, A.; Barroso, L.A.; Granville, S; Pereira, M. “Estratégias de Atuação de Agentes Geradores sob Incerteza em Leilões de Contratos de Energia Elétrica”, SNPTEE 2005 - XVIII Seminário Nacional de Produção e Transmissão de Energia Elétrica, Curitiba, Brasil, 2005.
- [47] Street, A.; Barroso, L. A.; Granville, S.; Pereira, M. V.; “Risk Constrained Portfolio Selection of Renewable Sources in Hydrothermal Electricity Markets,” *IEEE Trans. Power Syst.*, vol. 24, no. 3, Aug. 2008.
- [48] von Neumann, J.; Morgenstern, O. “Theory of Games and Economic Behaviour” Princeton Press, 1947; ISBN 0-691-00362-9.
- [49] *WindPower Monthly*, Vol 14, n° 4, April 1998, pags 45-46, Denmark.

[50] Wobben WindPower – Disponível em: www.wobben.com.br.

[51] World Energy Council (WEC) – Disponível em: www.worldenergy.org.