



E0473

ESTUDO DE INDICADORES DE RISCO PARA SELEÇÃO E OTIMIZAÇÃO DE CARTEIRAS DE PROSPECTOS PETROLÍFEROS

Igor Gimenes Cesca (Bolsista IC CNPq), Alexandre Vidal e Prof. Dr. Saul Barisnik Suslick (Orientador), Instituto de Geociências - IG, UNICAMP

As atividades de exploração apresentam elevado grau de incerteza em decorrência da ausência de informações, que envolvem desde o conhecimento geológico de maior escala culminando com o potencial petrolífero das áreas a serem avaliadas. As abordagens tradicionais de avaliação econômica dos projetos de exploração de petróleo devem necessariamente contemplar essas incertezas. Este projeto de pesquisa visa avaliar os impactos da dependência de prospectos petrolíferos seqüenciais, analisando o risco de prospectos sucederem e do valor de opção embutido na carteira de investimentos, buscando desenvolver um método para definição de uma seqüência ótima de prospectos que maximize o valor monetário esperado das diferentes seqüências de prospectos. A análise do valor de opção é importante no cálculo do risco, pois este permite também quantificar o risco envolvido no projeto de exploração, permitindo ao exploracionista uma melhor percepção das chances de sucesso, bem como uma avaliação mais coerente da estratégia exploratória. A escolha de tal estratégia envolve diversos níveis de dependência entre prospectos. Com o auxílio da simulação de Monte Carlo e de diagramas de árvore de decisão, buscamos desenvolver uma seqüência de passos que se aproxime das situações encontradas na atividade de exploração de petróleo.

Análise de risco - Petróleo - Portfólios