A Translation of

ТЕОРІЯ ЙМОВІРНОСТЕЙ ТА МАТЕМАТИЧНА СТАТИСТИКА

ВИПУСК 72  2005
Theory of Probability and Mathematical Statistics

Number 72  2006

A Translation of

ТЕОРІЯ ЙМОВІРНОСТЕЙ ТА МАТЕМАТИЧНА СТАТИСТИКА

ВИПУСК 72  2005

American Mathematical Society
Providence, Rhode Island  USA
ISSN 0094-9000
CONTENTS

Louiza Bouallouche and Djamil Aïssani, Measurement and performance of the strong stability method ......................................................... 1

V. V. Buldygin, O. I. Klesov, and J. G. Steinebach, PRV property of functions and the asymptotic behaviour of solutions of stochastic differential equations .......................................................... 11

O. K. Zakusylo and N. P. Lysak, On a queueing system with sequential service .......................................................... 27

O. V. Ivanov and I. V. Orlovskii, The asymptotic normality of the Koenker–Bassett estimators in nonlinear models ................................................. 33

H. Jönsson, A. G. Kukush, and D. S. Silvestrov, Threshold structure of optimal stopping strategies for American type option. II ......................... 47

M. V. Kartashov, The ergodicity and stability of quasi-homogeneous Markov semigroups of operators ......................................................... 59

V. O. Koval', Bounded law of the iterated logarithm for sums of independent random vectors normalized by matrices ............................................... 69

A. M. Kulik, Malliavin calculus for Lévy processes with arbitrary Lévy measures .......................................................... 75

I. K. Matsak, Some remarks on the ordinal strong law of large numbers …… 93

Yulia Mishura, An estimate of ruin probabilities for long range dependence models .................................................................................. 103

A. Ya. Olenko, An estimate of the mean square error of interpolation of stochastic processes .......................................................... 113

D. I. Pohyl'ko, Histogram estimators of the shape of the concentration function in a two-component mixture ................................................. 125

S. V. Posashkov, Optimal filtration for systems with fractional Brownian noises .......................................................... 135

A. Yu. Ryzhov, A test of the hypothesis about the homogeneity of components of a mixture with varying concentrations by using censored data .......... 145

O. V. Sugakova, Classification of components of a mixture .......................................................... 157

Georgii Shevchenko, Euler approximations of anticipating quasilinear stochastic differential equations ......................................................... 167

A. P. Yurachkovskii and D. O. Ivanenko, Estimation of a matrix-valued parameter of an autoregressive process with nonstationary noise .......... 177

M. I. Yadrenko and N. Semenovs'ka, The problem of estimation of unknown mean value for some correlation models of homogeneous and isotropic random fields .......................................................... 193
UKRAINIAN CONTENTS

Louiza Bouallouche, Djamil Aïssani
Measurement and performance of the strong stability method 1

В. В. Будницький, О. І. Клєсов, І. Г. Штайнцев
ПРВ властивість функцій та асимптотична поведінка розв’язків стохастичних диференціальних рівнянь 10

О. К. Закусило, Н. П. Лисак
Про одну систему масового обслуговування з послідовним обслуговуванням 24

О. В. Іванов, І. В. Орловський
Асимптотична нормальнасть оцінок Коенкера–Бассета у нелінійних моделях регресії 30

H. Jönsson, A. G. Kukush, D. S. Silvestrov
Threshold Structure of optimal stopping strategies for American type option. II 42

М. В. Карташов
Ергодичність та стійкість квазі-однорідних марковських напівгруп операторів 54

В. О. Коваль
Обмежений закон повторного логарифма для матрично-нормованих сум незалежних випадкових векторів 63

О. М. Кулик
Числення Маллявена для процесів Леві з довільними мірами Леві 67

І. К. Мацак
Зазначення до порядкового закону великих чисел 84

Юлія Міщура
Оцінка ймовірностей банкрутства для моделей з довгостроковою залежністю 93

А. Я. Оленко
Оцінка середньоквадратичної помилки інтерполяції випадкових процесів 101

Д. І. Погилько
Гістограмні оцінки форми функції концентрації двокомпонентної суміші 111

С. В. Посічков
Оптимальна фільтрація у системах з дробово-брунівськими шумами 120

А. Ю. Рижов
Перевірка гіпотези про однорідність компонент суміші зі змінними концентраціями за цензураними даними 129

*The American Mathematical Society scheme for transliteration of Cyrillic may be found at the end of index issues of Mathematical Reviews.
О. В. Сугакова
Розпізнавання компонентів суміші 140

Георгій Шевченко
Про Ейлерові апроксимації квазілінійних стохастичних диференціальних рівнянь з упередженням 150

А. П. Юрчієвський, Д. О. Іваненко
Оцінювання матричного параметра процесу авторегресії з нестационарним шумом 158

М. Й. Ядренко, Н. Семеновська
Задача оцінювання невідомого середнього значення для деяких кореляційних моделей однорідних та ізотропних випадкових полів 172