1. *Гнеденко. Курс теории вероятностей*

Марковским цепям посвящено всего около 5 страниц, но из них можно уяснить базовые вещи.

1. *Ширяев. Вероятность*

В этой книге есть значительная часть того, что нужно, и много такого, о чем я не говорю, но некоторые доказательства даются не в такой форме, в которой я их даю на лекциях (моя форма, естественно, мне нравится больше, но вы можете доказывать любым способом).

Есть более старое издание, в котором всего 1 том – оно годится; в более новом, двухтомном издании, нужен первый том. Кажется, во всех изданиях есть два раздела, посвященных марковским цепям: меньший, ближе к началу книги, и больший, ближе к концу. Нужен меньший.

1. *Феллер. Введение в теорию вероятностей и приложения. Том 1.*

Примерно та же история, что и в п.2. Отмечу большое количество содержательных примеров.

1. *Коралов, Синай. Теория вероятностей и случайных процессов.*

Относительно коротко (что хорошо), но нет примеров. Во многих доказательствах (например, в доказательстве эргодической теоремы и ЗБЧ) я следую этой книге.

1. *Кемени, Снелл. Конечные марковские цепи*

Книга целиком посвящена конечным марковским цепям и в основном там речь идет о том, о чем я не говорю вообще. Но почитать очень полезно.

Все книги легко скачиваются. Обратите внимание на то, что в большинстве из них речь идет о марковских цепях с бесконечным множеством состояний (а у нас оно конечно). От этого возникают некоторые дополнительные трудности и эффекты, которых у нас нет. Все, что в них содержится, верно и для марковских цепей с множеством состояний, иногда со значительными упрощениями.