

Основные определения

Определение 1. *Марковской цепью (Markov chain) называется пара $(\mathcal{S}, \mathcal{P})$, где*

1. \mathcal{S} – множество состояний.
2. \mathcal{P} – вероятность переходов $\{p(s_{t+1}|s_t) | t \in \{0, 1, 2, \dots\}, s_t, s_{t+1} \in \mathcal{S}\}$.

Что-то про теорему

Определение 2. *Марковская цепь называется **однородной** или **стационарной**, если вероятность перехода не зависит от времени:*

$$\forall t : p(s_{t+1}|s_t) = p(s_1|s_0)$$