D.- Mit Verfügung vom 24. April 2001 hat der Abteilungspräsident der Beschwerde antragsgemäss die aufschiebende Wirkung zuerkannt.

Das Bundesgericht zieht in Erwägung:

1.- a) Die Verwaltungsgerichtsbeschwerde ist gemäss Art. 97 OG in Verbindung mit Art. 5 VwVG zulässig gegen Verfügungen, die sich auf öffentliches Recht des Bundes stützen oder hätten stützen sollen, sofern sie von einer der in Art. 98 f. OG genannten Vorinstanzen erlassen worden sind und keiner der in Art. 99 ff. OG oder in der Spezialgesetzgebung vorgesehenen Ausschlussgründe vorliegt.

Nach Art. 100 Abs. 1 lit. b Ziff. 3 OG ist die Verwaltungsgerichtsbeschwerde auf dem Gebiet der Fremdenpolizei ausgeschlossen gegen die Erteilung oder Verweige-rung von Bewilligungen, auf die das Bundesrecht keinen Anspruch einräumt. Gemäss Art. 4 des Bundesgesetzes vom 26. März 1931 über Aufenthalt und Niederlassung der Ausländer (ANAG; SR 142. 20) entscheidet die zuständige

Behör-de, im Rahmen der gesetzlichen Vorschriften und der Verträge mit dem Ausland, nach freiem Ermessen über die Bewilligung von Aufenthalt und Niederlassung. Damit besteht kein Anspruch auf Erteilung einer Bewilligung, es sei denn, der Ausländer oder seine in der Schweiz lebenden Angehörigen könnten sich hierfür auf eine Sondernorm des Bundesrechts oder eines Staatsvertrags berufen (BGE 126 II 425 E. 1 S. 427, mit Hinweisen).

b) Das Verwaltungsgericht des Kantons Zürich ist auf die gegen den Beschluss des Regierungsrates erhobene Beschwerde nicht eingetreten, weil es zum Schluss gekommen war, dass die Beschwerdeführerin keinen Anspruch auf eine Anwesenheitsbewilligung in der Schweiz hat.

Der Kanton Zürich sieht eine sogenannte "anspruchsabhängige" Zugangsregelung vor, indem er auf dem Gebiet der Fremdenpolizei die Zulässigkeit der Beschwerde an das Verwaltungsgericht von der Zulässigkeit der eidgenössischen Verwaltungsgerichtsbeschwerde abhängig macht (§ 43 Abs. 1 lit. h in Verbindung mit Abs. 2 des Gesetzes vom 24. Mai 1959 über den Rechtsschutz in Verwaltungssachen, Verwaltungsrechtspflegegesetz, VRG; zur Publikation bestimmtes Urteil vom 18. Mai 2001 i.S. X.\_\_\_\_\_\_, E. 2a).

Tritt die nach Art. 98a OG zuständige kantonale Gerichtsinstanz - aufgrund einer zu Art. 100 Abs. 1 lit. b Ziff. 3 OG analogen Zugangsregelung - auf das bei ihr eingelegte Rechtsmittel nicht ein, weil sie einen Rechtsanspruch auf die streitige Bewilligung verneint, so kann der Betroffene zur Geltendmachung des Anspruches beim Bundesgericht Verwaltungsgerichtsbeschwerde führen. Die Zulässigkeit der Verwaltungsgerichtsbeschwerde setzt gemäss Art. 100 Abs. 1 lit. b Ziff. 3 OG allerdings voraus, dass der behauptete (grundsätzliche) Rechtsanspruch tatsächlich besteht, was vom Bundesgericht als Eintretensvoraussetzung geprüft wird (zur Publikation bestimmtes Urteil vom 18. Mai 2001 i.S. X.\_\_\_\_\_\_, E. 3a).

2.- Gemäss Art. 7 Åbs. 1 ÄNAG hat der ausländische Ehegatte eines Schweizer Bürgers Anspruch auf Erteilung und Verlängerung der Aufenthaltsbewilligung. Nach einem ordnungsgemässen und ununterbrochenen Aufenthalt von fünf Jahren hat er Anspruch auf die Niederlassungsbewilligung.

Mit dem Tod des Ehemannes der Beschwerdeführerin am 30. Juni 1998 wurde der rechtliche Bestand der Ehe beendet, womit ein Anspruch auf Verlängerung der Aufenthaltsbewilligung entfallen ist.

Die Beschwerdeführerin befindet sich zwar seit dem

1. November 1995 und damit seit über fünf Jahren in der Schweiz; ihre Ehe hat aber weniger als fünf Jahre gedauert.

Da für die Berechnung der Fünfjahresfrist im Sinne von Art. 7 Abs. 1 zweiter Satz ANAG einzig die Aufenthaltsdauer als Ehegattin eines Schweizers massgebend ist (BGE 122 II 145 E. 3b S. 147), hat die Beschwerdeführerin keinen Anspruch auf eine Niederlassungsbewilligung.

3.- a) Die Beschwerdeführerin beruft sich unter anderem auf das Abkommen vom 10. August 1964 zwischen der Schweiz und Italien über die Auswanderung italienischer Arbeitskräfte in der Schweiz (Italienerabkommen; SR 0.142. 114.548).

Gemäss Art. 11 Ziff. 1 lit. a des Italienerabkommens haben italienische Arbeitskräfte nach einem ordnungsgemässen und ununterbrochenen Aufenthalt von wenigstens fünf Jahren im Sinne einer Vorzugsbehandlung Anspruch auf Verlängerung der Aufenthaltsbewilligung für ihre Tätigkeit am bisherigen Arbeitsplatz.

- b) Die Erklärung vom 5. Mai 1934 über die Anwendung des Niederlassungs- und Konsularvertrags vom 22. Juli 1868 zwischen der Schweiz und Italien (Niederlassungsvereinbarung; SR 0.142. 114.541. 3) sieht in Ziff. 1 für italienische Staatsangehörige, die sich fünf Jahre ununterbrochen ordnungsgemäss in der Schweiz aufgehalten haben, einen Anspruch auf Erteilung der Niederlassungsbewilligung vor.
- c) Das Bundesgericht hat sich im Zusammenhang mit Ziff. 2 des Briefwechsels vom 12. April 1990 zwischen der Schweiz und Portugal über die administrative Stellung der Staatsangehörigen aus einem der beiden Länder im andern nach einer ordnungsgemässen und ununterbrochenen Aufenthaltsdauer von fünf Jahren (SR 0.142. 116.546) mit dem Begriff des ordnungsgemässen und ununterbrochenen Aufenthalts befasst. Es hat in Bezug auf Ziff. 2 des Briefwechsels, gemäss welcher portugiesische Staatsangehörige, die einen ordnungsgemässen und ununterbrochenen Aufenthalt von fünf Jahren in der Schweiz nachweisen können, die Niederlassungsbewilligung erhalten, festgehalten, dass nur ein von den zuständigen Behörden mit einer Aufenthaltsbewilligung

geregelter Aufenthalt als ordentlicher Aufenthalt im Sinne dieser Bestimmung gelten kann, nicht hingegen ein aufgrund der aufschiebenden Wirkung eines Rechtsmittels lediglich tolerierter Aufenthalt (unveröffentlichtes Urteil vom 22. Juni 1998 i.S. De Oliveira, 1a/bb).

Nichts anderes kann für den Begriff des ordnungsgemässen Aufenthalts im Sinne von Art. 11 des Italienerabkommens und im Sinne von Ziff. 1 der Niederlassungsvereinbarung gelten. Damit kann die Beschwerdeführerin weder aus dem Italienerabkommen noch aus der Niederlassungsvereinbarung einen Anspruch auf eine Anwesenheitsbewilligung ableiten.

4.- a) Art. 8 EMRK - wie seit dem 1. Januar 2000 auch Art. 13 Abs. 1 BV - gewährleistet das Recht auf Achtung des Privat- und Familienlebens.

Es kann Art. 8 Ziff. 1 EMRK verletzen, wenn einem Ausländer, dessen Familienangehörige in der Schweiz weilen, die Anwesenheit in der Schweiz untersagt wird. Vorausgesetzt wird nach ständiger bundesgerichtlicher Rechtsprechung, dass der hier weilende Familienangehörige selber ein gefestigtes Anwesenheitsrecht hat. Dies ist nicht nur der Fall, wenn dieser über das Schweizer Bürgerrecht oder eine Niederlassungsbewilligung verfügt, sondern auch dann, wenn er eine Aufenthaltsbewilligung hat, die ihrerseits auf einem festen Rechtsanspruch beruht. Soweit im Übrigen die familiäre Beziehung tatsächlich gelebt wird und intakt ist, wird das der zuständigen Behörde in Art. 4 ANAG grundsätzlich eingeräumte freie Ermessen eingeschränkt; in solchen Fällen ist daher die Verwaltungsgerichtsbeschwerde des um die fremdenpolizeiliche Bewilligung ersuchenden Ausländers oder seiner hier anwesenden Angehörigen zulässig (BGE 126 II 377 E. 2b S. 382, mit Hinweisen).

Der in Art. 13 Abs. 1 BV garantierte Anspruch auf Achtung des Privat- und Familienlebens entspricht materiell der Garantie von Art. 8 EMRK und gewährt im Bereich des Ausländerrechts keine weiter gehenden Ansprüche (BGE 126 II 377 E. 7 S. 394).

<li>b) Bei den Verwandten der Beschwerdeführerin, welche in der Schweiz über ein gefestigtes</li>
Anwesenheitsrecht verfügen, handelt es sich um ihre Schwester E, die Schweizer Bürgerin
ist, sowie um den Sohn D und dessen Tochter F, geboren ***, die offenbar beide
über eine Niederlassungsbewilligung verfügen. Ob der *** geborene Sohn C, der über eine
Jahresaufenthaltsbewilligung verfügt, einen Anspruch auf deren Verlängerung und damit ein
gefestigtes Anwesenheitsrecht in der Schweiz hat, geht aus den Akten nicht hervor.
Grundsätzlich ist der Schutzbereich von Art. 8 EMRK nicht auf die Kernfamilie beschränkt. Er erfasst
vielmehr die Beziehung zwischen allen nahen Verwandten, die in der Familie eine wesentliche Rolle
spielen können. Als solchermassen erweitertes Familienleben haben die Organe der Europäischen
Menschenrechtskonvention das Verhältnis von Grosseltern sowie Enkeln und Enkelinnen, zwischen
Onkeln und Tanten sowie Nichten und Neffen und insbesondere auch zwischen Geschwistern
anerkannt. Das heisst aber nicht, dass in diesen Fällen immer ein Anspruch auf fremdenpolizeiliche
Bewilligungen für die jeweiligen Angehörigen besteht. Geht es um Personen, die nicht der eigentlichen
Kernfamilie zuzurechnen sind, setzt eine schützenswerte Beziehung voraus, dass der um die
fremdenpolizeiliche Bewilligung ersuchende Ausländer vom hier Anwesenheitsberechtigten abhängig
ist (BGE 120 lb 257 E. 1d S. 260 f., mit Hinweisen).

Die Beschwerdeführerin ist von keiner dem der in der Schweiz lebenden Verwandten, die hier über ein gefestigtes Anwesenheitsrecht verfügen, im Sinne der bundesgerichtlichen Rechtsprechung abhängig; sie kann sich daher in Bezug auf ihre Schwester, ihren Sohn D.\_\_\_\_\_ und ihre Enkelin nicht auf Art. 8 Ziff. 1 EMRK bzw. Art. 13 BV berufen.

c) Die Beschwerdeführerin macht geltend, sie gehe täglich auf den Friedhof, um die Gräber ihrer Mutter sowie ihres Ehemannes zu besuchen.

Die Einreise in ein Land zum Besuch von Familiengräbern fällt zwar unter den Schutzbereich von Art. 8 Ziff. 1 EMRK (vgl. Jochen Frowein/Wolfgang Peukert, EMRKKommentar,

- 2. Aufl. 1996, Art. 8 N 26). Indessen wird der Beschwerdeführerin durch die Verweigerung einer Aufenthaltsbewilligung der Besuch der Gräber von Ehemann und Mutter nicht verunmöglicht, wie dies etwa bei einer Ausweisung der Fall wäre. Ein Anwesenheitsrecht lediglich zum Zweck eines häufigeren Besuches der Gräber verleiht Art. 8 Ziff. 1 EMRK aber nicht.
- d) Dem von Art. 8 Ziff. 1 EMRK umfassten Recht auf Privatleben kann in ausländerrechtlichen Fällen grundsätzlich eine (selbständige) Auffangfunktion gegenüber dem engeren Schutzbereich des Rechts auf Achtung des Familienlebens zukommen, wenn qualifizierte Familienbande nicht oder nicht mehr bestehen. Das Bundesgericht hat diesbezüglich allerdings festgehalten, aus dem Recht auf Achtung

des Privatlebens geradezu ein Anwesenheitsrecht abzuleiten, fiele höchstens dann in Betracht, wenn besonders intensive pri-vate Beziehungen in Frage stünden (BGE 126 II 377 E. 2c/aa S. 384 f., mit Hinweisen; 120 Ib 16 E. 3b S. 22). Bisher hat es nur ganz ausnahmsweise einen derartigen Anspruch anerkannt (vgl. den eine gleichgeschlechtliche Lebensgemeinschaft betreffenden BGE 126 II 425 ff.).

Im vorliegenden Fall erscheint weder die Beziehung der Beschwerdeführerin zu ihrer Schwiegertochter noch die Beziehung zu mehreren Freundinnen derart intensiv, dass sie solchen Anspruch auszulösen vermöchte.

- e) Im vorliegenden Fall besteht kein Anlass, die Beschwerdeführerin zu befragen oder die von ihr bezeichneten Personen als Zeugen einzuvernehmen.
- 5.- Die Beschwerdeführerin hat nach dem Gesagten keinen Anspruch auf eine Anwesenheitsbewilligung in der Schweiz.

Auf die Verwaltungsgerichtsbeschwerde ist daher nicht einzutreten.

Bei diesem Ausgang des Verfahrens sind die Gerichtskosten der Beschwerdeführerin aufzuerlegen (Art. 156 Abs. 1 in Verbindung mit Art. 153 und Art. 153a OG). Demnach erkennt das Bundesgericht:

- 1.- Auf die Verwaltungsgerichtsbeschwerde wird nicht eingetreten.
- 2.- Die Gerichtsgebühr von Fr. 2'000.-- wird der Beschwerdeführerin auferlegt.
- 3.- Dieses Urteil wird der Beschwerdeführerin, dem Regierungsrat und dem Verwaltungsgericht (2. Kammer) des Kantons Zürich sowie dem Bundesamt für Ausländerfragen schriftlich mitgeteilt.

Lausanne, 26. Juni 2001

Im Namen der II. öffentlichrechtlichen Abteilung des SCHWEIZERISCHEN BUNDESGERICHTS Der Präsident:

Die Gerichtsschreiberin: