Posterior Mean μ φ -0.3 **-**0.85 --0.4 **-**0.80 --0.5 **-**0.75 -0.70 --0.6 **-**PMMH VΒ PMMH $\sigma^{\!\scriptscriptstyle 2}$ $X_{T+1} \\$ −0.2 **-**0.020 --0.3 **-**-0.4 **-**0.016 --0.5 **-**0.012 --0.6 **-**VВ PMMH VВ PMMH