**字段说明：黄色部分为当日只需接受一次的数据**

///深度行情

struct CThostFtdcDepthMarketDataField

{

///交易日

TThostFtdcDateType TradingDay;

///合约代码

TThostFtdcInstrumentIDType InstrumentID;

///交易所代码

TThostFtdcExchangeIDType ExchangeID;

///合约在交易所的代码

TThostFtdcExchangeInstIDType ExchangeInstID;

///最新价

TThostFtdcPriceType LastPrice;

///上次结算价

TThostFtdcPriceType PreSettlementPrice;

///昨收盘

TThostFtdcPriceType PreClosePrice;

///昨持仓量

TThostFtdcLargeVolumeType PreOpenInterest;

///今开盘

TThostFtdcPriceType OpenPrice;

///最高价

TThostFtdcPriceType HighestPrice;

///最低价

TThostFtdcPriceType LowestPrice;

///数量

TThostFtdcVolumeType Volume;

///成交金额

TThostFtdcMoneyType Turnover;

///持仓量

TThostFtdcLargeVolumeType OpenInterest;

///今收盘

TThostFtdcPriceType ClosePrice;

///本次结算价

TThostFtdcPriceType SettlementPrice;

///涨停板价

TThostFtdcPriceType UpperLimitPrice;

///跌停板价

TThostFtdcPriceType LowerLimitPrice;

///昨虚实度

TThostFtdcRatioType PreDelta;

///今虚实度

TThostFtdcRatioType CurrDelta;

///最后修改时间

TThostFtdcTimeType UpdateTime;

///最后修改毫秒

TThostFtdcMillisecType UpdateMillisec;

///申买价一

TThostFtdcPriceType BidPrice1;

///申买量一

TThostFtdcVolumeType BidVolume1;

///申卖价一

TThostFtdcPriceType AskPrice1;

///申卖量一

TThostFtdcVolumeType AskVolume1;

///申买价二

TThostFtdcPriceType BidPrice2;

///申买量二

TThostFtdcVolumeType BidVolume2;

///申卖价二

TThostFtdcPriceType AskPrice2;

///申卖量二

TThostFtdcVolumeType AskVolume2;

///申买价三

TThostFtdcPriceType BidPrice3;

///申买量三

TThostFtdcVolumeType BidVolume3;

///申卖价三

TThostFtdcPriceType AskPrice3;

///申卖量三

TThostFtdcVolumeType AskVolume3;

///申买价四

TThostFtdcPriceType BidPrice4;

///申买量四

TThostFtdcVolumeType BidVolume4;

///申卖价四

TThostFtdcPriceType AskPrice4;

///申卖量四

TThostFtdcVolumeType AskVolume4;

///申买价五

TThostFtdcPriceType BidPrice5;

///申买量五

TThostFtdcVolumeType BidVolume5;

///申卖价五

TThostFtdcPriceType AskPrice5;

///申卖量五

TThostFtdcVolumeType AskVolume5;

///当日均价

TThostFtdcPriceType AveragePrice;

};