



भारतीय रिज़र्व बैंक
RESERVE BANK OF INDIA
www.rbi.org.in

PUN.CAB.APTP.No.

August 25, 2026

The Managing Director/ Chief Executive Officer
Scheduled Commercial Banks (SCBs)

Madam/ Dear Sir,

Programme on Market Risk Measurement & Management for SCBs: October 07-09, 2026 (in-campus)

Reserve Bank's College of Agricultural Banking (CAB), a premier training institution for bankers, is conducting the captioned in-campus training programme during October 07-09, 2026, at CAB, Pune. The broad objectives of the programme are:

- To explain and discuss regulatory requirements applicable to market risk activities of banks
- To impart thorough understanding of tools and techniques for assessing, monitoring, and managing market risk in banks

2. The Officers from Scheduled Commercial Banks working in risk management, compliance, treasury and capital planning functions are eligible for this programme. The programme intends to explain the key concepts in simple language and easy steps to augment the understanding of officers about the subject and also build the necessary skills for the same. The programme coverage is detailed in the **Annex**.

3. The training will be conducted in-campus at CAB, Pune for three days. The programme is residential and arrangements for lodging and boarding will be made in the hostel rooms in the College.

4. The accommodation for the participants opting for the residential option will be available from evening October 06, 2026 and they will have to vacate the allotted hostel rooms on conclusion of the programme or latest till 9:30 am the next morning i.e.,

कृषि बैंकिंग महाविद्यालय, विद्यापीठ मार्ग, पुणे - 411 016 (महाराष्ट्र) भारत
फोन : (91-020) 25582391 ई-मेल: cabacademic@rbi.org.in

College of Agricultural Banking, University Road, Pune - 411 016, (Maharashtra), INDIA

Phone : (91-020) 25582391 E-mail : cabacademic@rbi.org.in

हिंदी आसान है, इसका प्रयोग बढ़ाइये

October 10, 2026. The nominated officers should make their travel arrangements accordingly. Please note that overstay or accompanying guests are not permitted.

5. Shri Santosh Kumar Pandey, GM & MoF is the Programme Director.

6. Seats are limited and nominations will be accepted on a 'first-come-first serve' basis. The nomination form as per the attached format may please be sent to nomination.mrs@rbi.org.in latest by **September 25, 2026**. Please look at the **Annex** for fee details.

7. For nomination related enquiries you may contact Shri Amit Patil on 02025582344; or e-mail to nomination.mrs@rbi.org.in .

IMPORTANT DATES TO REMEMBER	
Programme Dates	October 07-09, 2026
Last date for receiving Nominations	September 25, 2026
Completion of programme	16.30 hours on October 09, 2026

PLEASE NOTE: The Fees may be remitted only after the confirmation of nomination by the College.

Please use the programme code – MRSP130 in Sender to Receiver Information while remitting the fee through NEFT.

Yours faithfully



(Shri Santosh Kumar Pandey)

Email: skpandey@rbi.org.in

Programme Director

Encl: Annex (*containing fee details and programme coverage*)



भारतीय रिज़र्व बैंक
RESERVE BANK OF INDIA
www.rbi.org.in

PUN.CAB.APTP.No.

25 अगस्त, 2026

प्रबंध निदेशक / मुख्य कार्यकारी अधिकारी
अनुसूचित वाणिज्यिक बैंक (SCBs)

प्रिय महोदय / महोदया,

अनुसूचित वाणिज्यिक बैंकों के लिए बाजार जोखिम मापन और प्रबंधन पर कार्यक्रम: 07-09 अक्टूबर, 2026 (कैंपस-में)

रिज़र्व बैंक का कृषि बैंकिंग महाविद्यालय (सीएबी), बैंकों के लिए एक प्रमुख प्रशिक्षण संस्थान, 07-09 अक्टूबर, 2026 के दौरान उपरोक्त विषय पर एक ऑन-कैंपस प्रशिक्षण कार्यक्रम आयोजित कर रहा है। कार्यक्रम के व्यापक उद्देश्य हैं:

- बैंकों की बाजार जोखिम गतिविधियों पर लागू विनियामक आवश्यकताओं की व्याख्या करना और उन पर चर्चा करना।
- बैंकों में बाजार जोखिम के आकलन, निगरानी और प्रबंधन के लिए उपकरणों और तकनीकों की गहन समझ प्रदान करना।

2. अनुसूचित वाणिज्यिक बैंकों में जोखिम प्रबंधन, अनुपालन, ट्रेजरी और पूंजी नियोजन कार्यों में काम करने वाले अधिकारी, इस कार्यक्रम के लिए पात्र हैं। कार्यक्रम का उद्देश्य मुख्य अवधारणाओं को सरल भाषा में समझाना और विषय के बारे में अधिकारियों की समझ को बढ़ाना और इसके लिए आवश्यक कौशल का निर्माण करना है। कार्यक्रम कवरेज अनुबंध में विस्तृत है।

3. प्रशिक्षण तीन दिनों के लिए कृषि बैंकिंग महाविद्यालय, भारतीय रिज़र्व बैंक, पुणे में आयोजित किया जाएगा। कार्यक्रम आवासीय है और महाविद्यालय के छात्रावास में ठहरने एवं खाने की व्यवस्था की जाएगी।

4. आवासीय विकल्प चुनने वाले प्रतिभागियों के लिए आवास 06 अक्टूबर, 2026 की शाम से उपलब्ध होगा और उन्हें कार्यक्रम समाप्त होने पर, या अगली सुबह यानी 10 अक्टूबर, 2026 को सुबह 9:30 बजे तक खाली करना होगा। नामित अधिकारी अपनी यात्रा की व्यवस्था उसी के अनुसार करें। ओवरस्टे और साथ आने वाले अतिथि की अनुमति नहीं है।

कृषि बैंकिंग महाविद्यालय, विद्यापीठ मार्ग, पुणे - 411 016 (महाराष्ट्र) भारत
फोन : (91-020) 25582391 ई-मेल: cabacademic@rbi.org.in

College of Agricultural Banking, University Road, Pune - 411 016, (Maharashtra), INDIA

Phone : (91-020) 25582391 E-mail : cabacademic@rbi.org.in

हिंदी आसान है, इसका प्रयोग बढ़ाइये

5. श्री संतोष कुमार पांडे, महाप्रबंधक एवं संकाय सदस्य, इस कार्यक्रम के कार्यक्रम निदेशक हैं।

6. नामांकन 'पहले-आओ-पहले पाओ' के आधार पर स्वीकार किए जाएंगे। संलग्न प्रारूप के अनुसार नामांकन फॉर्म कृपया 25 सितंबर, 2026 तक nomination.mrs@rbi.org.in पर भेजे जा सकते हैं। कार्यक्रम के शुल्क की जानकारी के लिए अनुबंध देखें।

7. नामांकन संबंधी पूछताछ के लिए आप श्री अमित पाटील को 02025582344 नंबर पर संपर्क कर सकते हैं अथवा nomination.mrs@rbi.org.in पर ई-मेल करें।

याद करने के लिए महत्वपूर्ण तिथियाँ	
कार्यक्रम दिनांक	07-09 अक्टूबर, 2026
नामांकन की अंतिम तिथि	25 सितंबर, 2026
कार्यक्रम का समापन	09 अक्टूबर, 2026 को 16.30 बजे

कृपया ध्यान दें: केवल कॉलेज द्वारा नामांकन की पुष्टि के बाद ही शुल्क का भुगतान किया जा सकता है।

पाठ्यक्रम शुल्क का NEFT द्वारा भुगतान करते समय कृपया प्रोग्राम कोड – MRSP130 का उल्लेख Sender to Receiver Information करें।

भवदीय



(श्री संतोष कुमार पांडे)

ईमेल: skpandey@rbi.org.in

कार्यक्रम निदेशक

संलग्नक: अनुबंध (शुल्क विवरण और कार्यक्रम कवरेज सहित)

Programme Coverage

Module 1: Foundations of Market Risk Management

- Introduction to Market Risk
- Valuation of Financial Instruments

Module 2: Market Risk Measurement

- Market Risk Measurement
- Computation of Risk Measures
- Computation of Probabilistic Measures for a Sample Portfolio
- The shift from Value at Risk (VaR) to Expected Shortfall (ES)

Module 3: Emerging Regulatory Requirements related to market risk portfolio of banks

- Discussion on the likely impact of the recent changes in the accounting requirements
- Major Supervisory Concerns on Market Risk Management
- Discussion on the likely impact due to changes in the Capital Requirements

Fee Structure

Group	Group Wise Fee Details	Total Tuition Fees per participant for the programme (for 3 days) including GST @ 18%	
		Residential	Non-Residential
Group 1	Commercial Banks	₹ 20,768/-	₹ 12,862/-
Group 3	Small Finance Banks	₹ 10,384/-	₹ 6,490/-
* In terms of section 48 of RBI Act 1934, RBI is exempted from payment of Income Tax or Super Tax on any of its Income, Profits or Gains. Nominating institutions should therefore not deduct TDS on the Programme Fees.			
Please use the programme code – MRSP130 in Sender to Receiver Information while remitting the fee through NEFT.			
GST (Reg. No. 27AAIFR5286M1ZG)			