



## Dr. Csóka Péter

Egyetemi tanár / Professor

### Végzettségek, tudományos fokozatok

#### Felsőfokú végzettségek

- 1998 - 2003  
Budapesti Közgazdaságtudományi és Államigazgatási Egyetem , Befektetéselemző és kockázatkezelő (főiskolai)

#### Tudományos fokozatok, címek

- 2008, PhD  
Maastricht University
- 2017, Dr.Habil  
BCE, Gazdálkodástudományi Kar

### Szakmai életút

#### Korábbi és jelenlegi munkahelyek, munkakörök és beosztások

- 2004 - 2008  
Maastrichti Egyetem, egyetemi tanársegéd
- 2008 -  
Budapesti Corvinus Egyetem (BCE), egyetemi tanársegéd, majd adjunktus, majd 2011-től docens, majd 2019-től egyetemi tanár
- 2011 -  
Közgazdaság-tudományi Intézet, Játékelméleti Kutatócsoport, Tudományos munkatárs (2016-tól tudományos főmunkatárs)

#### Egyetemi közéleti tevékenységek (testületi tagságok, vezetői megbízatások)

- 2014 - 2020  
Financial Research Centre, Corvinus University of Budapest, igazgató
- 2012 - 2016  
Biztosítási és Pénzügyi Matematika Ms.c. Kvantitatív pénzügyek szakirány BCE: szakirányfelelős
- 2012 - 2020  
Corvinus lectures in finance, szervező
- 2012 -  
Annual financial market liquidity conference, Budapest: főszervező
- 2010 - 2019  
Gazdálkodástudományi kar, Kutatási bizottság tagja

# Munkatársi önéletrajz: Dr. Csóka Péter

- 2012 -  
MTA Közgazdaság-tudományi Bizottság, Pénzügytani Albizottság: titkár, 2015-től alelnök, majd 2018-tól elnök

## Díjak, címek, kitüntetések

- 2009, Kutatási kiválósági ösztöndíj  
BCE
  - 2010, Az év fiatal kutatója  
BCE GTK
  - 2011, Kutatási kiválósági ösztöndíj  
BCE
  - 2012, OTKA posztdoktori ösztöndíj  
OTKA
- 
- 2015, Kiemelkedő publikációs díj  
BCE GTK
  - 2016, Kutatási kiválósági ösztöndíj  
BCE
  - 2016, Posztdoktori ösztöndíj  
Új Nemzeti Kiválósági Program
  - 2017, Posztdoktori ösztöndíj  
Új Nemzeti Kiválósági Program
  - 2019, Bolyai János Kutatási Ösztöndíj  
Magyar Tudományos Akadémia
  - 2020, Kiváló Mentor Díj  
BCE
  - 2021, Corvinus Research Excellence Award  
BCE

## Nyelvismeret

Nyelv	Beszéd	Írás	Olvasás	Médiaszereplést vállal-e rajta?
angol	felső	felső	felső	
német	közép	közép	közép	

## Kutatás, szakértői tevékenység

### Fontosabb, oktatott tárgyak, témakörök:

Vállalati pénzügyek, Játékelmélet, Empirikus pénzügyek, Befektetések

### Tudományterület és tudományág:

Közgazdaságtudományok

### Jelenlegi kutatási témák:

# Munkatársi önéletrajz: Dr. Csóka Péter

Kockázatfelosztás nem likvid piacokon és rendszerkockázat esetén; hitelszűkösség; portfólió-optimalizálás nem likvid eszközökre; társadalmi választások elmélete, rendszerkockázat

## Korábbi kutatási témák:

Kockázatelosztási játékok; koherens kockázati mértékek, egzakt kooperatív játékok átruházható és nem átruházható hasznossággal

## Fontosabb kutatások

- 2010 - 2010, N° EAC/47/2009 Feasibility study to examine the potential need for a student lending facility at European level

Részvétel formája: a kutatócsoport tagja

---

Finanszírozó: European Commission Directorate-General for Education and Culture

További információk a kutatásról: The general purpose of the project is to make lifelong learning and mobility a reality, by reducing financial barriers. The main tasks are: + description and evaluation of present practices + evaluating the Community Added Value (CAV) + creating new pan-European institution

- 2012 - 2014, FuturICT.hu - Infocommunication technologies and the society of the future

Részvétel formája: a kutatócsoport tagja

Finanszírozó:

További információk a kutatásról: Financial systems subproject Infection analysis and the investigation of cascade effects focus on graph modelling of the interrelated business entities and on evaluating the speed and radius of an infection or the probability of a system collapse. Game theoretical investigations are pursued to measure the fairness of contracts and corresponding risk distributions, and multimedia data mining is applied to reveal the sentiments of a business and discover the correlation and impact of sentiments on the stock prices. In this way, a fast identification of favourable patterns in time series becomes feasible on small time scales, which can give rise to profitable trading where asset prices can follow each other in second and millisecond intervals.

- 2012 - 2015, Risk allocation in illiquid markets and in case of systemic risk

Részvétel formája: kutatásvezető

Finanszírozó: OTKA

További információk a kutatásról: If a financial enterprise (bank, insurance company, investment fund, etc.) consists of subunits (individuals, products, subportfolios, divisions etc.), not only is it important to measure properly the risk of the main entity, but also to allocate the diversification benefits to the subunits using a proper risk allocation method. The purpose of the project is to analyze risk allocation in illiquid markets and in case of systemic risk, using game theory and simulation.

- 2011 - 2012, Measuring and allocating risk of illiquid portfolios

Részvétel formája: kutatásvezető

Finanszírozó: MSCI

További információk a kutatásról: In finance risk capital allocation is an important question from both theoretical and practical point of view. How to share risk of a portfolio among its subportfolios? How to reserve capital in order to hedge existing risk and how to assign this to different business units? We use an axiomatic approach to examine risk capital allocation, i.e. we call for fundamental properties of the methods. The starting point of this working paper is the theorem of Csóka and Pintér (2010) who showed that the requirements of Core Compatibility, Equal Treatment Property and Strong Monotonicity are irreconcilable given that risk is quantified by a coherent measure of risk. In this project we examine these requirements using analytical and simulation tools.

# Munkatársi önéletrajz: Dr. Csóka Péter

## Tagság tudományos vagy szakmai szervezetben, testületben

- 2009 - , Köztestületi Tag, tag  
MTA , országos
- 2009 - , tag, tag  
Gazdaságmodellezési társaság, országos
- 2007 - , tag, tag  
Magyar Közgazdaságtudományi Egyesület, országos
- 2012 - , tag, tag  
Game theory society, nemzetközi
- 2012 - 2014, titkár, vezető (elnök, igazgató stb)  
MTA Közgazdaság-tudományi Bizottság, Pénzügytani Albizottság , országos

---

- 2010 - 2014, Zsűritag, tag  
OTKA KJS, országos
- 2015 - 2017, alelnök, vezető (elnök, igazgató stb)  
MTA Közgazdaság-tudományi Bizottság, Pénzügytani Albizottság , országos
- 2017 - , Management Committee Substitute, vezető (elnök, igazgató stb)  
[COST Action CA16228, European Network for Game Theory](#), nemzetközi
- 2019 - , elnökségi tag, vezető (elnök, igazgató stb)  
[Magyar Közgazdaságtudományi Egyesület](#), országos
- 2018 - 2020, elnök, vezető (elnök, igazgató stb)  
MTA Közgazdaság-tudományi Bizottság, Pénzügytani Albizottság , országos

## Szerkesztőbizottsági tagságok és pozíciók

- 2016 - 2020, FRL, Associate Editor, a szerkesztőbizottság tagja, vezetője  
[idegen nyelvű](#)
- 2016 - , JIFMIM, Subject Editor, a szerkesztőbizottság tagja, vezetője  
[idegen nyelvű](#)
- 2016 - , EMEMAR, Subject Editor, a szerkesztőbizottság tagja, vezetője  
[idegen nyelvű](#)
- 2016 - , SEF, Associate Editor, a szerkesztőbizottság tagja, vezetője  
[idegen nyelvű](#)

## Szakértői tanácsadási tevékenységek

- 2010 - 2010  
Magyar Posta Zrt.,
- 2013 - 2014  
KELER KSZF, Hungarian Clearing House and Central Counterparty, Kockázati modellek auditálása
- 2018 - 2018  
KELER KSZF, Hungarian Clearing House and Central Counterparty, Kockázati modellek auditálása

## Publikációk

- [A Magyar Tudományos Művek Tárában \(MTMT\) található publikációim.](#)

## Elérhetőségek

### Egyetemi tartózkodási hely

- Épület: E

# Munkatársi önéletrajz: Dr. Csóka Péter

Szobaszám: 263

Mellék:

Fővonal:

Fax:

Belső fax:

E-mail cím: peter.csoka@uni-corvinus.hu

Személyes honlap: <https://sites.google.com/view/peter-csoka-personal/home>

## Fogadóóra:

szerda 14:00-15:30

---

## Egyéb szakmai profilok

LinkedIn: <https://www.linkedin.com/in/p%C3%A9ter-cs%C3%B3ka-50273b5b/>

MTMT:

<https://www.google.com/url?q=https%3A%2F%2Fm2.mtmt.hu%2Fgui%2F%3Ftype%3Dauthors%26mode%3Dbrowse%26sel%3D10013432&sa=D&sntz=1&usg=AFQjCNEB6jEqkcEOV8PUJJHPhOOGP6xb6w>

Scholar: <https://scholar.google.hu/citations?user=SwW4jyAAAAAJ&hl=en>

Egyéb szakmai profilok1: <https://sites.google.com/view/peter-csoka-personal/>