



Investissement

États financiers intermédiaires (non audités) 30 juin 2022

Fonds SSQ



Table des matières

	Page
Fonds SSQ Marché monétaire Fiera Capital	3
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital	8
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital	13
Fonds SSQ Obligations PIMCO	18
Fonds SSQ Obligations et prêts bancaires AlphaFixe	23
Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO	28
Fonds SSQ Obligations de sociétés CI	33
Fonds SSQ Indice obligataire BlackRock	38
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire	43
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré	48
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - croissance	53
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux	58
Fonds SSQ Stratégie sécuritaire	64
Fonds SSQ Stratégie équilibrée	69
Fonds SSQ Stratégie croissance	74
Fonds SSQ Stratégie audacieuse	79
Fonds SSQ Stratégie 100% actions	84
Fonds SSQ Celestia sécuritaire	89
Fonds SSQ Celestia équilibré	94
Fonds SSQ Celestia croissance	99
Fonds SSQ Celestia audacieux	104
Fonds SSQ Célestia 100% actions	109
Fonds SSQ Revenu sécuritaire Guardian	115
Fonds SSQ Revenu Guardian	120
Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI	125
Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI	130
Fonds SSQ Actions canadiennes dividendes Guardian	135
Fonds SSQ Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée	140
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima	145
Fonds SSQ Indice canadien BlackRock	151
Fonds SSQ Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital	156
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale	161
Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman	168
Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital	173
Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	178
Fonds SSQ Indice américain BlackRock	183
Fonds SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher	188
Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners	193
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide	198
Fonds SSQ Indice international BlackRock	204
Fonds SSQ Actions mondiales dividendes TD	209
Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital	214
Fonds SSQ Actions mondiales GQG Partners	219
Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Fisher	224
Fonds SSQ Actions marchés émergents Fisher	229
Fonds SSQ Infrastructures mondiales Lazard	234
Fonds SSQ Immobilier mondial CI	239
Notes complémentaires aux états financiers	244
Annexe – informations financières	281

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	34 127	14 156
Trésorerie	78	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	3	17
Total de l'actif	34 208	14 173
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	196
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	4	5
Total du passif	4	201
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	34 204	13 972
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,00	10,00
Classe B	10,00	10,00
Classe C	10,00	10,00
Classe E	10,00	10,00
Classe F	10,00	10,00
Classe G	10,00	10,00
Classe I	10,00	10,00
Classe J	10,00	10,00
Classe N	10,00	10,00

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	-	-
Non réalisé(e) sur les placements	-	-
Total gain net (perte nette)	-	-
Intérêts aux fins d'attribution	68	95
Distributions par le fonds sous-jacent	76	17
	144	112
Charges		
Frais de gestion (note 6)	120	98
Frais d'administration	8	6
Frais de transactions	-	-
	128	104
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	16	8
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	-	-
Classe B	-	-
Classe C	-	-
Classe E	-	-
Classe F	-	-
Classe G	-	-
Classe I	0,05	0,01
Classe J	0,05	-
Classe N	-	-

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	13 972	20 439
Opérations sur les parts		
Parts émises	28 803	32 387
Parts rachetées	(8 571)	(13 014)
	20 232	19 373
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(16)	(8)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	16	8
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	34 204	39 812

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	16	8
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	-	-
Distributions par le fonds sous-jacent	(76)	(17)
	(60)	(9)
Transactions de placements		
Acquisitions	(24 215)	(28 980)
Cessions	4 320	9 715
	(19 895)	(19 265)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	13	11
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(19 942)	(19 263)
Financement		
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(16)	(8)
Parts émises	28 803	32 387
Parts rachetées	(8 571)	(13 014)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	20 216	19 365
Variation nette de la trésorerie	274	102
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(196)	(72)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	78	30
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,77 %)			
Fonds Fiera de gestion active d'encaisse, Catégorie A	3 412 701	34 127	34 127
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,23 %)			77
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			34 204

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera de gestion active d'encaisse, Catégorie A</i>	%
Fédération des Caisses Desjardins du Québec, 2,01 %, 05-07-2022	3,70
Banque Nationale du Canada, 1,96 %, 20-07-2022	3,45
Société Financière Manuvie, 1,96 %, 18-07-2022	3,33
Nestlé SA, 1,95 %, 21-07-2022	2,59
Province du Manitoba, 1,64 %, 13-07-2022	2,58
Province de l'Ontario, 1,67 %, 20-07-2022	2,51
Caisse de dépôt et placement du Québec, 2,01 %, 05-07-2022	2,46
Province de la Nouvelle-Écosse, 1,55 %, 05-07-2022	2,46
HSBC Holdings PLC, 1,99 %, 02-08-2022	2,46
Banque de Nouvelle-Écosse, 1,99 %, 02-08-2022	2,46

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Marché monétaire Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera de gestion active d'encaisse, Catégorie A. Par conséquent, le Fonds SSQ Marché monétaire Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion basée sur une analyse descendante de l'économie, qui combine l'anticipation des taux d'intérêt fondée sur une analyse fondamentale de l'environnement économique et des mouvements attendus de la banque centrale, ainsi que l'allocation active du crédit.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	34 127	-	-	34 127
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	34 127	-	-	34 127

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	14 156	-	-	14 156
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	14 156	-	-	14 156

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	59 873	58 600
Trésorerie	-	754
Cession de placements à recevoir	595	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	60 468	59 354
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	567	-
Achat de placements à payer	-	505
Autres créditeurs	9	5
Total du passif	576	510
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	59 892	58 844
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,48	11,15
Classe B	10,21	10,85
Classe C	10,51	11,18
Classe E	10,49	11,16
Classe F	10,51	11,18
Classe G	10,45	11,11
Classe I	12,02	12,66
Classe J	12,02	12,66
Classe K	12,02	12,66
Classe N	10,48	11,15

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(478)	1 223
Non réalisé(e) sur les placements	(3 263)	(2 149)
Total gain net (perte nette)	(3 741)	(926)
Intérêts aux fins d'attribution	-	702
Prêts de titres	-	5
Distributions par le fonds sous-jacent	674	103
	(3 067)	(116)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	114	168
Frais d'administration	6	8
Frais de transactions	-	-
	120	176
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 187)	(292)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,66)	(0,13)
Classe B	(0,64)	(0,13)
Classe C	(0,65)	(0,13)
Classe E	(0,66)	(0,13)
Classe F	(0,66)	(0,13)
Classe G	(0,65)	(0,13)
Classe I	(0,62)	(0,02)
Classe J	(0,62)	(0,02)
Classe K	(0,62)	(0,02)
Classe N	(0,66)	(0,13)

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	58 844	72 800
Opérations sur les parts		
Parts émises	20 594	32 393
Parts rachetées	(16 359)	(36 134)
	4 235	(3 741)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 187)	(292)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	59 892	68 767

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 187)	(292)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	3 741	926
Distributions par le fonds sous-jacent	(674)	(103)
	(120)	531
Transactions de placements		
Acquisitions	(13 660)	(134 939)
Cessions	8 220	138 345
	(5 440)	3 406
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	4	345
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(5 556)	4 282
Financement		
Parts émises	20 594	32 393
Parts rachetées	(16 359)	(36 134)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	4 235	(3 741)
Variation nette de la trésorerie	(1 321)	541
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	754	269
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(567)	810
Intérêts reçus	-	1 055
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,97 %)			
Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations à court terme, Série A	6 480 215	<u>64 024</u>	<u>59 873</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,03 %)			<u>19</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>59 892</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

*Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations à court terme,
Série A*

	%
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	8,49
Province de Québec, 3,00 %, 01-09-2023	5,09
Province de Québec, 3,75 %, 01-09-2024	4,50
Province de l'Ontario, 2,90 %, 02-06-2028	3,57
Province de l'Ontario, 2,60 %, 08-09-2023	3,29
Banque Royale du Canada, 2,33 %, 28-01-2027	3,10
Province de Québec, 2,75 %, 01-09-2025	2,18
Financière Sun Life Inc., 2,80 %, 21-11-2033	1,94
Banque Toronto-Dominion, 3,11 %, 22-04-2030	1,63
Banque de Montréal, 2,70 %, 11-09-2024	1,59

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera ASFI- Gestion active obligations à court terme, Séries A. Le Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez-vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement vise d'abord la préservation du capital et favorise une approche de gestion basée sur l'anticipation des taux d'intérêt, la gestion de la courbe d'échéance, le choix des secteurs et le choix des titres. La gestion des écarts de crédit et la synchronisation des interventions sont également considérées.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	59 873	-	-	59 873
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	59 873	-	-	59 873

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	58 600	-	-	58 600
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	58 600	-	-	58 600

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	30 juin 2022	31 décembre 2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	238 887	297 706
Trésorerie	-	342
Cession de placements à recevoir	1 360	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	240 247	298 048
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	1 493	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	259	74
Total du passif	1 752	74
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	238 495	297 974
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,33	12,02
Classe B	10,05	11,69
Classe C	10,35	12,05
Classe D	10,22	11,89
Classe E	10,36	12,05
Classe F	10,35	12,04
Classe G	10,32	12,00
Classe H	10,22	11,89
Classe I	12,01	13,82
Classe J	12,01	13,82
Classe K	12,01	13,82
Classe N	10,35	12,04

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(7 014)	(183)
Non réalisé(e) sur les placements	(35 263)	(15 243)
Total gain net (perte nette)	(42 277)	(15 426)
Intérêts aux fins d'attribution	1	1
Distributions par le fonds sous-jacent	3 669	1 645
	(38 607)	(13 780)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	476	651
Frais d'administration	22	31
Frais de transactions	-	-
	498	682
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(39 105)	(14 462)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,70)	(0,63)
Classe B	(1,65)	(0,61)
Classe C	(1,70)	(0,63)
Classe D	(1,71)	(0,62)
Classe E	(1,70)	(0,63)
Classe F	(1,70)	(0,62)
Classe G	(1,69)	(0,62)
Classe H	(1,68)	(0,62)
Classe I	(1,82)	(0,56)
Classe J	(1,82)	(0,55)
Classe K	(1,82)	(0,55)
Classe N	(1,71)	(0,63)

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	297 974	350 516
Opérations sur les parts		
Parts émises	43 759	49 057
Parts rachetées	(64 133)	(48 262)
	(20 374)	795
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(39 105)	(14 462)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	238 495	336 849

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(39 105)	(14 462)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	42 277	15 426
Distributions par le fonds sous-jacent	(3 669)	(1 645)
	(497)	(681)
Transactions de placements		
Acquisitions	(106 605)	(23 210)
Cessions	125 456	23 235
	18 851	25
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	185	(10)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	18 539	(666)
Financement		
Parts émises	43 759	49 057
Parts rachetées	(64 133)	(48 262)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(20 374)	795
Variation nette de la trésorerie	(1 835)	129
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	342	3 195
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(1 493)	3 324
Intérêts reçus	1	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,16 %)				
Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations canadiennes univers, Catégorie A	67,15	17 207 724	188 760	160 164
Fonds Fiera ASFI - Gestion stratégique obligations canadiennes Univers, Catégorie P	33,01	9 003 505	90 476	78 723
TOTAL DES PLACEMENTS (100,16 %)			279 236	238 887
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,16 %)				(392)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				238 495

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations canadiennes univers, Catégorie A</i>		%
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-12-2031		17,24
Fiera Capital Gestion active - municipale à court terme		16,30
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-06-2031		10,84
Gouvernement du Canada, 0,50 %, 01-12-2030		3,27
Gouvernement du Canada, 5,75 %, 01-06-2033		3,04

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera ASFI - Gestion stratégique obligations canadiennes Univers, Catégorie P</i>		%
Province de l'Ontario, 2,25 %, 02-12-2031		26,55
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-12-2031		6,39
Royal Office Finance LP, 5,21 %, 12-11-2032		4,26
Toronto Community Housing Corp., 4,88 %, 11-05-2037		3,43
Banque Royale du Canada, 1,67 %, 28-01-2028		2,34

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans les fonds sous-jacents Fiera ASFI – Gestion active obligations canadiennes univers, Catégorie A et Fiera ASFI - Gestion stratégique obligations canadiennes Univers, Catégorie P. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion complémentaire. L'actif du fonds est composé d'environ 67 % du fonds Fiera ASFI – Gestion active obligations canadiennes univers (approche de gestion basée sur la durée, la courbe d'échéance et le crédit) et 33 % du Fonds Fiera ASFI - Gestion stratégique obligations canadiennes Univers (approche de gestion qui met l'accent sur le positionnement sur la courbe).

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	238 887	-	-	238 887
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	238 887	-	-	238 887

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	297 706	-	-	297 706
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	297 706	-	-	297 706

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	83 712	103 411
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	1 145	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	84 857	103 411
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	1 164	129
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	56	63
Total du passif	1 220	192
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	83 637	103 219
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,91	11,52
Classe B	9,64	11,21
Classe C	9,93	11,55
Classe E	9,93	11,55
Classe F	9,92	11,54
Classe G	9,89	11,50
Classe I	11,60	13,34
Classe J	11,60	13,34
Classe L	10,35	11,91
Classe N	9,92	11,54

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(2 423)	(130)
Non réalisé(e) sur les placements	(13 190)	(5 391)
Total gain net (perte nette)	(15 613)	(5 521)
Distributions par le fonds sous-jacent	1 513	1 882
	(14 100)	(3 639)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	361	454
Frais d'administration	16	20
Frais de transactions	-	-
	377	474
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(14 477)	(4 113)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,63)	(0,48)
Classe B	(1,58)	(0,47)
Classe C	(1,63)	(0,48)
Classe E	(1,63)	(0,48)
Classe F	(1,63)	(0,48)
Classe G	(1,62)	(0,48)
Classe I	(1,75)	(0,40)
Classe J	(1,75)	(0,40)
Classe L	(1,56)	(0,35)
Classe N	(1,63)	(0,48)

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	103 219	121 286
Opérations sur les parts		
Parts émises	21 240	25 912
Parts rachetées	(26 345)	(24 328)
	(5 105)	1 584
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(14 477)	(4 113)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	83 637	118 757

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(14 477)	(4 113)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	15 613	5 521
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 513)	(1 882)
	(377)	(474)
Transactions de placements		
Acquisitions	(14 427)	(13 995)
Cessions	18 881	12 235
	4 454	(1 760)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(7)	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	4 070	(2 236)
Financement		
Parts émises	21 240	25 912
Parts rachetées	(26 345)	(24 328)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(5 105)	1 584
Variation nette de la trésorerie	(1 035)	(652)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(129)	1 609
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(1 164)	957
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,09 %)			
PIMCO Canada Canadian CorePLUS Bond Trust	967 882	100 236	83 712
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,09 %)			(75)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			83 637

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>PIMCO Canada Canadian CorePLUS Bond Trust</i>	%
Contrat à terme Gouvernement du Canada 10 ans, 6,00 %, 21-09-2022	6,91
Contrat à terme Gouvernement du Canada 5 ans, 6,00 %, 21-09-2022	5,96
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-12-2051	3,17
Province de l'Ontario, 3,45 %, 02-06-2045	2,28
Province de l'Alberta, 2,90 %, 01-12-2028	2,06
Gouvernement du Canada, 3,50 %, 01-12-2045	1,96
Province de l'Ontario, 1,55 %, 11-01-2029	1,91
Province de l'Ontario, 5,85 %, 08-03-2033	1,83
Province de l'Alberta, 2,90 %, 20-09-2029	1,76
Gouvernement du Canada, 1,75 %, 01-12-2053	1,70

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations PIMCO est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent PIMCO Canada Canadian CorePLUS Bond Trust. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations PIMCO se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par PIMCO Canada selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion basée sur la diversification des sources de valeur ajoutée tout en minimisant le risque du portefeuille.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	83 712	-	-	83 712
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	83 712	-	-	83 712

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	103 411	-	-	103 411
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	103 411	-	-	103 411

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	84 039	104 828
Trésorerie	-	739
Cession de placements à recevoir	385	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	84 424	105 567
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	767	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	23	34
Total du passif	790	34
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	83 634	105 533
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,54	10,52
Classe B	9,50	10,47
Classe E	9,55	10,53
Classe F	9,55	10,53
Classe G	9,54	10,52
Classe I	10,55	11,49
Classe J	10,55	11,49
Classe N	9,55	10,53

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(1 761)	(2)
Non réalisé(e) sur les placements	(8 371)	(1 928)
Total gain net (perte nette)	(10 132)	(1 930)
Distributions par le fonds sous-jacent	1 508	1 262
	(8 624)	(668)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	112	169
Frais d'administration	4	7
Frais de transactions	-	-
	116	176
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(8 740)	(844)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,98)	(0,20)
Classe B	(0,97)	(0,20)
Classe E	(0,98)	(0,20)
Classe F	(0,97)	(0,20)
Classe G	(0,98)	(0,20)
Classe I	(0,94)	(0,08)
Classe J	(0,94)	(0,08)
Classe N	(0,97)	(0,20)

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	105 533	85 050
Opérations sur les parts		
Parts émises	21 134	28 767
Parts rachetées	(34 293)	(3 940)
	(13 159)	24 827
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(8 740)	(844)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	83 634	109 033

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(8 740)	(844)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	10 132	1 930
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 508)	(1 262)
	(116)	(176)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 005)	(25 320)
Cessions	21 785	350
	11 780	(24 970)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(11)	10
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	11 653	(25 136)
Financement		
Parts émises	21 134	28 767
Parts rachetées	(34 293)	(3 940)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(13 159)	24 827
Variation nette de la trésorerie	(1 506)	(309)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	739	1 412
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(767)	1 103
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,48 %)			
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	9 264 560	92 970	84 039
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,48 %)			(405)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			83 634

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F</i>	%
Fonds ESG Alphafixe - prêts bancaires à taux variable, Série F	36,44
Province de l'Ontario, 1,85 %, 01-02-2027	2,38
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	2,04
Hydro-Québec, 2,00 %, 01-09-2028	2,02
Province de Québec, 2,75 %, 01-09-2025	1,93
Gouvernement du Canada, Rendement Réel, 2,00 %, 01-12-2041	1,86
Province de l'Ontario, 1,55 %, 01-11-2029	1,48
Province de l'Ontario, 2,80 %, 02-06-2048	1,15
Réseau de transport de la Capitale, 1.00%, 18-11-2025	1,08
Province de l'Ontario, 2,70 %, 02-06-2029	1,08

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations et prêts bancaires AlphaFixe est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations et prêts bancaires AlphaFixe se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par AlphaFixe Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion combinant l'analyse structurelle et cyclique afin de déterminer les projections économiques et la direction des marchés financiers.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	84 039	-	-	84 039
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	84 039	-	-	84 039

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	104 828	-	-	104 828
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	104 828	-	-	104 828

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	45 907	55 669
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	-	2 575
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	45 907	58 244
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	155	28
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	28	2 400
Total du passif	183	2 428
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	45 724	55 816
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,48	11,34
Classe B	10,19	11,02
Classe C	10,51	11,37
Classe E	10,52	11,38
Classe F	10,50	11,36
Classe G	10,45	11,30
Classe I	12,62	13,47
Classe J	12,62	13,47
Classe L	10,76	11,49
Classe N	10,51	11,37

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(442)	117
Non réalisé(e) sur les placements	(3 383)	(469)
Total gain net (perte nette)	(3 825)	(352)
Distributions par le fonds sous-jacent	434	516
	(3 391)	164
Charges		
Frais de gestion (note 6)	210	239
Frais d'administration	8	9
Frais de transactions	-	-
	218	248
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 609)	(84)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,86)	(0,13)
Classe B	(0,83)	(0,13)
Classe C	(0,86)	(0,13)
Classe E	(0,86)	(0,13)
Classe F	(0,85)	(0,13)
Classe G	(0,85)	(0,12)
Classe I	(0,85)	0,03
Classe J	(0,85)	0,03
Classe L	(0,72)	0,03
Classe N	(0,86)	(0,13)

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	55 816	67 623
Opérations sur les parts		
Parts émises	7 911	9 056
Parts rachetées	(14 394)	(11 605)
	(6 483)	(2 549)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 609)	(84)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	45 724	64 990

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 609)	(84)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	3 825	352
Distributions par le fonds sous-jacent	(434)	(516)
	(218)	(248)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 712)	(2 667)
Cessions	12 658	5 267
	8 946	2 600
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2 372)	(1)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	6 356	2 351
Financement		
Parts émises	7 911	9 056
Parts rachetées	(14 394)	(11 605)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(6 483)	(2 549)
Variation nette de la trésorerie	(127)	(198)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(28)	751
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(155)	553
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,40 %)				
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	33,09	1 209 238	17 047	15 130
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada), Série I	67,31	3 101 999	32 614	30 777
TOTAL DES PLACEMENTS (100,40 %)			49 661	45 907
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,40 %)				(183)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				45 724

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Fannie Mae TBA, 3,50 %, 01-08-2052	6,90
Fannie Mae TBA, 4,00 %, 01-04-2052	5,00
Fannie Mae TBA, 3,50 %, 01-07-2052	2,90
Citigroup Mortgage Loan Trust, 0,00 %, 01-11-2061	2,50
Jamestown Residential DAC, 0,34 %, 24-06-2059	1,90

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Gouvernement de Singapour, 1,63 %, 01-07-2031	1,40
Contrat à terme obligation américaine, 1,88 %, 15-02-2041	1,20
Nykredit Realkredit AS, 1,00 %, 01-10-2050	1,10
Ripon Mortgages PLC, 1,35 %, 28-08-2056	1,00
Nykredit Realkredit AS, 1,50 %, 01-10-2053	0,90

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO est un fonds distinct qui investit exclusivement dans les fonds sous-jacents Revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I et Obligations mondiales flexible PIMCO (Canada), Série I. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par PIMCO Canada selon une méthode de gestion qui lui est propre. L'actif du fonds est composé d'environ 33 % du Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada) (approche de gestion tactique des meilleures idées de revenus à l'échelle mondiale) et 67 % du Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (approche de gestion active en obligations mondiales qui met l'accent sur les pays ayant les meilleures dynamiques de PIB et d'endettement).

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	45 907	-	-	45 907
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	45 907	-	-	45 907

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	55 669	-	-	55 669
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	55 669	-	-	55 669

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	30 887	36 624
Trésorerie	-	850
Cession de placements à recevoir	290	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	31 177	37 474
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	280	-
Achat de placements à payer	-	790
Autres créditeurs	21	19
Total du passif	301	809
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	30 876	36 665
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,38	11,75
Classe B	10,18	11,53
Classe E	10,41	11,78
Classe F	10,40	11,77
Classe G	10,36	11,72
Classe I	12,10	13,52
Classe J	12,10	13,52
Classe N	10,40	11,77

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(652)	50
Non réalisé(e) sur les placements	(4 454)	48
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	208	72
Total gain net (perte nette)	(4 898)	170
Distributions par le fonds sous-jacent	881	658
	(4 017)	828
Charges		
Frais de gestion (note 6)	310	254
Frais d'administration	12	10
Frais de transactions	-	-
	322	264
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(4 339)	564
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,37)	0,21
Classe B	(1,34)	0,20
Classe E	(1,37)	0,21
Classe F	(1,37)	0,21
Classe G	(1,37)	0,21
Classe I	(1,41)	0,41
Classe J	(1,44)	0,41
Classe N	(1,37)	0,21

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	36 665	26 605
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 538	8 065
Parts rachetées	(9 988)	(7 143)
	(1 450)	922
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(4 339)	564
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	30 876	28 091

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(4 339)	564
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	5 106	(98)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 089)	(730)
	(322)	(264)
Transactions de placements		
Acquisitions	(5 460)	(4 260)
Cessions	6 100	3 635
	640	(625)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2	1
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	320	(888)
Financement		
Parts émises	8 538	8 065
Parts rachetées	(9 988)	(7 143)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 450)	922
Variation nette de la trésorerie	(1 130)	34
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	850	96
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(280)	130
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,04 %)			
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I	3 333 765	35 494	30 887
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,04 %)			(11)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			30 876

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I</i>	%
Sporting Life Group Ltd, Catégorie B	1,14
Fairfax India Holdings Corp., 5,00 % 26-02-2028	1,12
Dresdner Funding Trust I, 8,15 %, 30-06-2031	1,04
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-06-2032	0,87
General Electric Co., 5,00 %, 31-12-2049	0,80
SkyMiles IP Ltd Term Loan B, 5,95 %, 20-10-2027	0,75
Inter Pipeline Ltd, 6,63 %, 19-11-2079	0,72
Citigroup Capital XIII, 7,88 %, 30-10-2040	0,70
Inter Pipeline Ltd, 6,88 %, 26-03-2079	0,69
Pembina Pipeline Corp., 4,80 %, 25-01-2081	0,62

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations de sociétés CI est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent obligations de sociétés CI, Catégorie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations de sociétés CI se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement vise à sélectionner un choix de titres dont le gestionnaire estime que la valeur fondamentale n'est pas reflétée dans la cote de crédit et le rendement courant.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	30 887	-	-	30 887
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	30 887	-	-	30 887

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	36 624	-	-	36 624
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	36 624	-	-	36 624

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	40 890	65 998
Trésorerie	-	2 296
Cession de placements à recevoir	200	300
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	41 090	68 594
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	611	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	20	2 760
Total du passif	631	2 760
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	40 459	65 834
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,45	12,05
Classe B	10,17	11,72
Classe C	10,47	12,07
Classe E	10,48	12,08
Classe F	10,48	12,08
Classe G	10,44	12,02
Classe I	12,15	13,85
Classe J	12,15	13,85
Classe N	10,50	12,09

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(2 397)	1
Non réalisé(e) sur les placements	(5 604)	(1 239)
Total gain net (perte nette)	(8 001)	(1 238)
Distributions par le fonds sous-jacent	828	322
	(7 173)	(916)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	38	59
Frais d'administration	2	3
Frais de transactions	-	-
	40	62
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(7 213)	(978)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,68)	(0,57)
Classe B	(1,63)	(0,55)
Classe C	(1,68)	(0,57)
Classe E	(1,68)	(0,57)
Classe F	(1,68)	(0,57)
Classe G	(1,67)	(0,57)
Classe I	(1,77)	(0,49)
Classe J	(1,80)	(0,49)
Classe N	(1,68)	(0,57)

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	65 834	26 082
Opérations sur les parts		
Parts émises	11 571	4 971
Parts rachetées	(29 733)	(4 539)
	(18 162)	432
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(7 213)	(978)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	40 459	25 536

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(7 213)	(978)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	8 001	1 238
Distributions par le fonds sous-jacent	(828)	(322)
	(40)	(62)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 050)	(3 750)
Cessions	28 085	3 285
	18 035	(465)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2 740)	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	15 255	(527)
Financement		
Parts émises	11 571	4 971
Parts rachetées	(29 733)	(4 539)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(18 162)	432
Variation nette de la trésorerie	(2 907)	(95)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	2 296	(5)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(611)	(100)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (101,07 %)			
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D	1 488 621	46 370	40 890
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-1,07 %)			(431)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			40 459

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D</i>	%
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-06-2031	1,52
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-12-2031	1,38
Gouvernement du Canada, 1,25 %, 01-06-2030	1,30
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-12-2051	1,30
Gouvernement du Canada, 0,50 %, 01-09-2025	1,15
Gouvernement du Canada, 0,50 %, 01-12-2030	1,04
Gouvernement du Canada, 1,75 %, 01-12-2053	0,97
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 2,90 %, 15-06-2024	0,93
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-09-2023	0,86
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-06-2032	0,82

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Indice obligataire BlackRock est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D. Par conséquent, le Fonds SSQ Indice obligataire BlackRock se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par BlackRock Asset Management et vise à reproduire la tendance de l'indice FTSE TMX Canada Univers.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	40 890	-	-	40 890
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	40 890	-	-	40 890

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	65 998	-	-	65 998
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	65 998	-	-	65 998

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	20 214	21 691
Trésorerie	128	-
Cession de placements à recevoir	17	290
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	20 359	21 981
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	238
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	21	21
Total du passif	21	259
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 338	21 722
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,94	10,97
Classe B	9,95	10,98
Classe C	9,96	10,99
Classe E	9,95	10,98
Classe F	9,96	11,00
Classe G	9,96	10,99
Classe I	10,76	11,72
Classe J	10,76	11,72
Classe N	9,95	10,98

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	39	122
Non réalisé(e) sur les placements	(1 992)	491
Total gain net (perte nette)	(1 953)	613
Distributions par le fonds sous-jacent	166	152
	(1 787)	765
Charges		
Frais de gestion (note 6)	236	271
Frais d'administration	10	11
Frais de transactions	-	-
	246	282
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 033)	483
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,03)	0,20
Classe B	(1,03)	0,20
Classe C	(1,03)	0,21
Classe E	(1,03)	0,20
Classe F	(1,03)	0,21
Classe G	(1,03)	0,21
Classe I	(0,97)	0,35
Classe J	(0,97)	0,35
Classe N	(1,03)	0,20

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	21 722	25 417
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 170	2 310
Parts rachetées	(2 521)	(4 967)
	649	(2 657)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 033)	483
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	20 338	23 243

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 033)	483
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	1 953	(613)
Distributions par le fonds sous-jacent	(166)	(152)
	(246)	(282)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 608)	(527)
Cessions	1 571	3 406
	(37)	2 879
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-	77
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(283)	2 674
Financement		
Parts émises	3 170	2 310
Parts rachetées	(2 521)	(4 967)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	649	(2 657)
Variation nette de la trésorerie	366	17
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(238)	193
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	128	210
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,39 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	52,07	1 167 750	11 819	10 592
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z	7,92	123	1 796	1 610
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	15,67	135 656	2 991	3 187
Fonds américain à faible volatilité TD	13,84	139 788	2 666	2 814
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	9,89	106 591	2 135	2 011
TOTAL DES PLACEMENTS (99,39 %)			21 407	20 214
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,61 %)				124
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				20 338

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire est un fonds distinct qui investit dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (60 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F, (page 63)	AlphaFixe Capital
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z (page 63)	TOBAM

Actions canadiennes (16 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (24 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds américain à faible volatilité TD (page 63)	Gestion de placements TD
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD (page 63)	Gestion de placements TD

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	20 214	-	-	20 214
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	20 214	-	-	20 214

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	21 691	-	-	21 691
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	21 691	-	-	21 691

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	27 315	31 740
Trésorerie	232	121
Cession de placements à recevoir	80	-
Autres débiteurs	(4)	-
Total de l'actif	27 623	31 861
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	165	-
Autres créditeurs	33	34
Total du passif	198	34
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 425	31 827
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,03	11,08
Classe B	10,03	11,08
Classe C	10,03	11,09
Classe E	10,03	11,09
Classe F	10,06	11,12
Classe G	10,04	11,09
Classe I	10,87	11,85
Classe J	10,87	11,85
Classe N	10,03	11,08

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	76	(202)
Non réalisé(e) sur les placements	(2 747)	1 773
Total gain net (perte nette)	(2 671)	1 571
Distributions par le fonds sous-jacent	126	114
	(2 545)	1 685
Charges		
Frais de gestion (note 6)	355	406
Frais d'administration	14	16
Frais de transactions	-	-
	369	422
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 914)	1 263
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,05)	0,38
Classe B	(1,05)	0,38
Classe C	(1,05)	0,39
Classe E	(1,05)	0,39
Classe F	(1,05)	0,39
Classe G	(1,05)	0,39
Classe I	(0,98)	0,54
Classe J	(0,98)	0,54
Classe N	(1,05)	0,38

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	31 827	39 176
Opérations sur les parts		
Parts émises	2 512	2 420
Parts rachetées	(4 000)	(11 385)
	(1 488)	(8 965)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 914)	1 263
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	27 425	31 474

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 914)	1 263
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 671	(1 571)
Distributions par le fonds sous-jacent	(126)	(114)
	(369)	(422)
Transactions de placements		
Acquisitions	(724)	(2 007)
Cessions	2 689	11 525
	1 965	9 518
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	3	(4)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 599	9 092
Financement		
Parts émises	2 512	2 420
Parts rachetées	(4 000)	(11 385)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 488)	(8 965)
Variation nette de la trésorerie	111	127
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	121	(130)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	232	(3)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,60 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	28,05	847 901	8 640	7 692
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z	3,42	72	1 021	939
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z	8,41	176	2 596	2 306
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	20,77	242 420	5 414	5 696
Fonds américain à faible volatilité TD	17,99	245 067	4 721	4 933
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	20,96	304 813	6 146	5 749
TOTAL DES PLACEMENTS (99,60 %)			28 538	27 315
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,40 %)				110
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				27 425

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré est un fonds distinct qui investit dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (40 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F, (page 63)	AlphaFixe Capital
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z (page 63)	TOBAM
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z (page 63)	TOBAM

Actions canadiennes (21 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (39 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds américain à faible volatilité TD (page 63)	Gestion de placements TD
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD (page 63)	Gestion de placements TD

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	27 315	-	-	27 315
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	27 315	-	-	27 315

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	31 740	-	-	31 740
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	31 740	-	-	31 740

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2022	31 décembre 2021
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	9 541	11 204
Trésorerie	7	90
Cession de placements à recevoir	70	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	9 618	11 294
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	26	-
Autres créditeurs	18	21
Total du passif	44	21
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	9 574	11 273
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,02	11,05
Classe B	10,01	11,04
Classe C	10,02	11,04
Classe E	10,03	11,05
Classe F	10,06	11,08
Classe G	10,04	11,06
Classe I	10,87	11,83
Classe J	10,87	11,82
Classe N	10,01	11,04

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	7	(304)
Non réalisé(e) sur les placements	(918)	961
Total gain net (perte nette)	(911)	657
Distributions par le fonds sous-jacent	28	26
	(883)	683
Charges		
Frais de gestion (note 6)	131	153
Frais d'administration	5	6
Frais de transactions	-	-
	136	159
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 019)	524
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,02)	0,43
Classe B	(1,02)	0,43
Classe C	(1,02)	0,43
Classe E	(1,02)	0,43
Classe F	(1,02)	0,44
Classe G	(1,02)	0,43
Classe I	(0,94)	0,59
Classe J	(0,95)	0,59
Classe N	(1,02)	0,43

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	11 273	13 669
Opérations sur les parts		
Parts émises	491	759
Parts rachetées	(1 171)	(3 844)
	(680)	(3 085)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 019)	524
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	9 574	11 108

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 019)	524
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	911	(657)
Distributions par le fonds sous-jacent	(28)	(26)
	(136)	(159)
Transactions de placements		
Acquisitions	(367)	(1 268)
Cessions	1 103	4 444
	736	3 176
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(3)	(3)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	597	3 014
Financement		
Parts émises	491	759
Parts rachetées	(1 171)	(3 844)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(680)	(3 085)
Variation nette de la trésorerie	(83)	(71)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	90	(89)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	7	(160)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,66 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	17,53	184 974	1 881	1 678
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z	3,48	25	358	333
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z	9,05	66	952	866
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	20,72	84 477	1 873	1 984
Fonds américain à faible volatilité TD	18,96	90 169	1 740	1 815
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	29,92	151 915	3 110	2 865
TOTAL DES PLACEMENTS (99,66 %)			9 914	9 541
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,34 %)				33
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				9 574

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - croissance se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - croissance est un fonds distinct qui investit dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (30 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 63)	AlphaFixe Capital
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z (page 63)	TOBAM
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z (page 63)	TOBAM

Actions canadiennes (21 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (49 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds américain à faible volatilité TD (page 63)	Gestion de placements TD
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD (page 63)	Gestion de placements TD

Juste valeur des instruments financiers

Le tableau suivant présente les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	9 541	-	-	9 541
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	9 541	-	-	9 541

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	11 204	-	-	11 204
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	11 204	-	-	11 204

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	6 829	7 894
Trésorerie	36	-
Cession de placements à recevoir	5	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	6 870	7 894
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	3
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	21	23
Total du passif	21	26
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	6 849	7 868
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,08	11,10
Classe B	10,08	11,10
Classe C	10,09	11,11
Classe E	10,08	11,10
Classe F	10,11	11,12
Classe G	10,08	11,10
Classe I	10,96	11,90
Classe J	10,96	11,90
Classe N	10,09	11,10

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	34	(206)
Non réalisé(e) sur les placements	(645)	764
Total gain net (perte nette)	(611)	558
Distributions par le fonds sous-jacent	11	10
	(600)	568
Charges		
Frais de gestion (note 6)	92	107
Frais d'administration	3	4
Frais de transactions	-	-
	95	111
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(695)	457
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,01)	0,54
Classe B	(1,02)	0,54
Classe C	(1,01)	0,54
Classe E	(1,01)	0,54
Classe F	(1,01)	0,55
Classe G	(1,01)	0,54
Classe I	(0,94)	0,71
Classe J	(0,94)	0,71
Classe N	(1,01)	0,54

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)

(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	7 868	10 100
Opérations sur les parts		
Parts émises	437	428
Parts rachetées	(761)	(3 132)
	(324)	(2 704)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(695)	457
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	6 849	7 853

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(695)	457
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	611	(558)
Distributions par le fonds sous-jacent	(11)	(10)
	(95)	(111)
Transactions de placements		
Acquisitions	(188)	(1 050)
Cessions	648	3 867
	460	2 817
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2)	(12)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	363	2 694
Financement		
Parts émises	437	428
Parts rachetées	(761)	(3 132)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(324)	(2 704)
Variation nette de la trésorerie	39	(10)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(3)	32
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	36	22
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,71 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	10,10	76 339	769	692
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share Classe Z	3,46	18	255	237
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share Classe Z	6,50	34	496	445
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	23,75	69 204	1 488	1 626
Fonds américain à faible volatilité TD	17,97	61 135	1 167	1 231
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	37,93	137 760	2 755	2 598
TOTAL DES PLACEMENTS (99,71 %)			6 930	6 829
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,29 %)				20
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				6 849

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux est un fonds distinct qui investit dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (20 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 63)	AlphaFixe Capital
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z (page 63)	TOBAM
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z (page 63)	TOBAM

Actions canadiennes (24 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (56 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds américain à faible volatilité TD (page 63)	Gestion de placements TD
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD (page 63)	Gestion de placements TD

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	6 829	-	-	6 829
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	6 829	-	-	6 829

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	7 894	-	-	7 894
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	7 894	-	-	7 894

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

Au 30 juin 2022

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD</i>	%
Atmos Energy Corp.	1,50
Eversource Energy	1,49
Tokio Marine Holdings Inc.	1,48
The Procter & Gamble Co.	1,47
Swisscom AG	1,47

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds américain à faible volatilité TD</i>	%
Safety Insurance Group Inc.	1,55
Consolidated Edison Inc.	1,47
Atmos Energy Corp.	1,47
The Hershey Co.	1,47
Merck & Co. Inc.	1,46

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F</i>	%
Fonds ESG Alphafixe - prêts bancaires à taux variable, Série F	36,44
Province de l'Ontario, 1,85 %, 01-02-2027	2,38
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	2,04
Hydro-Québec, 2,00 %, 01-09-2028	2,02
Province de Québec, 2,75 %, 01-09-2025	1,93

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share Classe Z</i>	%
Titres du trésor des États-Unis, 3,00 %, 30-06-2024	6,00
Titres du trésor des États-Unis, 1,25 %, 30-11-2026	1,61
Directv financing LCC, 2,25 %, 15-08-2027	1,48
Telenet Finance Luxembourg Note Sarl, 5,50%, 01-03-2028	1,38
Warner Music Group, 3,75%, 01-12-2029	1,31

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share Classe Z</i>	%
Weibo Corp., 3,50 %, 05-07-2024	2,12
Kingsgate Consolidated Ltd, 5,95 %, 15-03-2024	1,60
AstraZeneca PLC, 0,70 %, 08-04-2026	1,49
Kraft Heinz Co., 3,88 %, 15-05-2027	1,25
Delta Air Lines Inc., 4,50 %, 20-10-25	1,13

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	100 687	143 462
Trésorerie	-	342
Cession de placements à recevoir	455	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	101 142	143 804
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	278	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	41	51
Total du passif	319	51
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	100 823	143 753
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,02	14,83
Classe B	12,64	14,41
Classe C	13,10	14,93
Classe E	13,10	14,93
Classe F	13,05	14,87
Classe G	12,97	14,78
Classe I	15,67	17,62
Classe J	15,72	17,67
Classe L	13,96	15,69
Classe N	13,10	14,93

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	102	1 852
Non réalisé(e) sur les placements	(15 260)	1 668
Total gain net (perte nette)	(15 158)	3 520
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 033	712
	(14 124)	4 232
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 390	1 517
Frais d'administration	54	59
Frais de transactions	-	-
	1 444	1 576
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(15 568)	2 656
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,84)	0,29
Classe B	(1,79)	0,28
Classe C	(1,85)	0,29
Classe E	(1,86)	0,29
Classe F	(1,85)	0,29
Classe G	(1,83)	0,29
Classe I	(1,99)	0,56
Classe J	(1,99)	0,56
Classe L	(1,76)	0,50
Classe N	(1,87)	0,29

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	143 753	122 962
Opérations sur les parts		
Parts émises	13 888	22 993
Parts rachetées	(41 250)	(20 153)
	(27 362)	2 840
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(15 568)	2 656
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	100 823	128 458

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(15 568)	2 656
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	15 158	(3 520)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 033)	(712)
	(1 443)	(1 576)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 782)	(8 590)
Cessions	29 977	7 785
	28 195	(805)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(10)	9
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	26 742	(2 372)
Financement		
Parts émises	13 888	22 993
Parts rachetées	(41 250)	(20 153)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(27 362)	2 840
Variation nette de la trésorerie	(620)	468
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	342	503
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(278)	971
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,87 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	27,57	3 063 775	30 672	27 792
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	10,08	845 411	11 054	10 165
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	27,77	2 331 486	32 838	28 001
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	6,91	236 152	7 790	6 971
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	9,89	424 476	9 135	9 972
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	2,91	63 013	2 685	2 935
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	2,93	151 462	2 482	2 951
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	5,89	190 728	4 625	5 933
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	5,92	562 847	5 964	5 967
TOTAL DES PLACEMENTS (99,87 %)			107 245	100 687
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,13 %)				136
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				100 823

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Stratégie sécuritaire se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Stratégie sécuritaire est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (65 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (17 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (18 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	100 687	-	-	100 687
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	100 687	-	-	100 687

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	143 462	-	-	143 462
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	143 462	-	-	143 462

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILBRÉE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	215 816	251 334
Trésorerie	164	645
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	215 980	251 979
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	140	139
Total du passif	140	139
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	215 840	251 840
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,12	16,49
Classe B	13,79	16,10
Classe C	14,28	16,68
Classe E	14,28	16,68
Classe F	14,16	16,53
Classe G	14,00	16,35
Classe I	17,15	19,75
Classe J	17,15	19,75
Classe L	15,46	17,81
Classe N	14,28	16,67

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILIBRÉE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	484	4 915
Non réalisé(e) sur les placements	(35 447)	9 447
Total gain net (perte nette)	(34 963)	14 362
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 730	1 240
	(33 232)	15 602
Charges		
Frais de gestion (note 6)	2 601	2 586
Frais d'administration	98	97
Frais de transactions	-	-
	2 699	2 683
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(35 931)	12 919
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(2,36)	0,75
Classe B	(2,31)	0,73
Classe C	(2,39)	0,76
Classe E	(2,39)	0,76
Classe F	(2,37)	0,76
Classe G	(2,34)	0,75
Classe I	(2,60)	1,13
Classe J	(2,60)	1,13
Classe L	(2,34)	1,02
Classe N	(2,39)	0,76

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILIBRÉE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	251 840	240 885
Opérations sur les parts		
Parts émises	23 279	35 346
Parts rachetées	(23 348)	(29 036)
	(69)	6 310
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(35 931)	12 919
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	215 840	260 114

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(35 931)	12 919
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	34 963	(14 362)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 730)	(1 240)
	(2 698)	(2 683)
Transactions de placements		
Acquisitions	(9 956)	(20 444)
Cessions	12 241	17 354
	2 285	(3 090)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1	(1)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(412)	(5 774)
Financement		
Parts émises	23 279	35 346
Parts rachetées	(23 348)	(29 036)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(69)	6 310
Variation nette de la trésorerie	(481)	536
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	645	363
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	164	899
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILIBRÉE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,99 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	20,30	4 830 738	48 397	43 820
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	5,06	908 096	11 909	10 919
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	20,41	3 668 733	51 271	44 061
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	8,92	652 186	20 806	19 251
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A	4,92	31 520	9 696	10 613
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	12,90	1 185 469	24 493	27 850
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,90	180 500	7 197	8 407
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	4,86	551 574	12 125	10 490
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,92	433 831	6 507	8 452
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	7,38	512 109	12 512	15 931
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	7,42	1 511 275	15 973	16 022
TOTAL DES PLACEMENTS (99,99 %)			220 886	215 816
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,01 %)				24
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				215 840

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILBRÉE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Stratégie équilibrée se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Stratégie équilibrée est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (45 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (27 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowky Fraser (page 114)	Jarislowky Fraser Limitée
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (28 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust (page 114)	Fisher Investments
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	215 816	-	-	215 816
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	215 816	-	-	215 816

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	251 334	-	-	251 334
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	251 334	-	-	251 334

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	71 457	84 102
Trésorerie	245	123
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	71 702	84 225
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	48	96
Total du passif	48	96
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	71 654	84 129
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,77	19,87
Classe B	16,45	19,49
Classe C	17,03	20,18
Classe E	17,04	20,19
Classe F	16,83	19,94
Classe G	16,58	19,64
Classe I	20,54	24,00
Classe J	20,64	24,12
Classe L	16,69	19,51
Classe N	17,04	20,18

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	274	1 267
Non réalisé(e) sur les placements	(12 857)	4 865
Total gain net (perte nette)	(12 583)	6 132
Distributions par le fonds sous-jacent	451	355
	(12 132)	6 487
Charges		
Frais de gestion (note 6)	800	825
Frais d'administration	30	31
Frais de transactions	-	-
	830	856
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 962)	5 631
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(3,10)	1,23
Classe B	(3,04)	1,20
Classe C	(3,15)	1,25
Classe E	(3,15)	1,25
Classe F	(3,11)	1,24
Classe G	(3,06)	1,22
Classe I	(3,46)	1,75
Classe J	(3,47)	1,76
Classe L	(2,81)	1,42
Classe N	(3,14)	1,25

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	84 129	75 742
Opérations sur les parts		
Parts émises	7 449	9 045
Parts rachetées	(6 962)	(7 158)
	487	1 887
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 962)	5 631
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	71 654	83 260

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 962)	5 631
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	12 583	(6 132)
Distributions par le fonds sous-jacent	(451)	(355)
	(830)	(856)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 071)	(5 989)
Cessions	3 584	4 549
	513	(1 440)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(48)	7
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(365)	(2 289)
Financement		
Parts émises	7 449	9 045
Parts rachetées	(6 962)	(7 158)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	487	1 887
Variation nette de la trésorerie	122	(402)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	123	583
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	245	181
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,73 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	15,26	1 205 871	12 134	10 938
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	15,35	915 833	12 917	10 999
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	9,94	241 195	7 781	7 120
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A	5,92	12 591	3 776	4 240
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	14,93	455 293	9 317	10 696
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	7,81	120 165	4 877	5 597
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	5,85	220 260	4 769	4 189
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	7,85	288 795	4 552	5 626
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	8,39	193 177	4 726	6 009
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	8,43	570 028	6 023	6 043
TOTAL DES PLACEMENTS (99,73 %)			70 872	71 457
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,27 %)				197
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				71 654

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Stratégie croissance se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Stratégie croissance est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (30 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (31 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (39 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust (page 114)	Fisher Investments
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	71 457	-	-	71 457
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	71 457	-	-	71 457

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	84 102	-	-	84 102
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	84 102	-	-	84 102

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	38 317	45 877
Trésorerie	112	52
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	15	-
Total de l'actif	38 444	45 929
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	92	100
Total du passif	92	100
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	38 352	45 829
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,10	19,19
Classe B	15,72	18,73
Classe C	16,36	19,49
Classe E	16,36	19,50
Classe F	16,15	19,24
Classe G	15,85	18,89
Classe I	19,87	23,34
Classe J	19,98	23,46
Classe L	17,85	20,97
Classe N	16,36	19,49

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	233	1 179
Non réalisé(e) sur les placements	(7 177)	2 604
Total gain net (perte nette)	(6 944)	3 783
Distributions par le fonds sous-jacent	199	169
	(6 745)	3 952
Charges		
Frais de gestion (note 6)	478	470
Frais d'administration	17	17
Frais de transactions	-	-
	495	487
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(7 240)	3 465
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(3,08)	1,42
Classe B	(3,01)	1,38
Classe C	(3,13)	1,44
Classe E	(3,13)	1,44
Classe F	(3,08)	1,43
Classe G	(3,03)	1,40
Classe I	(3,45)	2,00
Classe J	(3,48)	2,00
Classe L	(3,10)	1,79
Classe N	(3,13)	1,44

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	45 829	40 399
Opérations sur les parts		
Parts émises	2 339	3 428
Parts rachetées	(2 576)	(4 995)
	(237)	(1 567)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(7 240)	3 465
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	38 352	42 297

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(7 240)	3 465
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	6 944	(3 783)
Distributions par le fonds sous-jacent	(199)	(169)
	(495)	(487)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 501)	(2 372)
Cessions	2 316	4 752
	815	2 380
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(23)	2
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	297	1 895
Financement		
Parts émises	2 339	3 428
Parts rachetées	(2 576)	(4 995)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(237)	(1 567)
Variation nette de la trésorerie	60	328
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	52	19
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	112	347
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,91 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	10,23	432 432	4 340	3 923
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	10,29	328 463	4 633	3 945
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	10,98	142 706	4 644	4 212
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A	6,94	7 902	2 445	2 661
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	17,00	277 582	5 835	6 521
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	7,85	64 620	2 701	3 010
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	6,85	138 241	3 041	2 629
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	7,89	155 339	2 579	3 026
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	10,91	134 483	3 359	4 183
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	10,97	396 806	4 195	4 207
TOTAL DES PLACEMENTS (99,91 %)			37 772	38 317
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,09 %)				35
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				38 352

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Stratégie audacieuse se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Stratégie audacieuse est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (35 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (45 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust (page 114)	Fisher Investments
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	38 317	-	-	38 317
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	38 317	-	-	38 317

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	45 877	-	-	45 877
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	45 877	-	-	45 877

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	93	51
Trésorerie	235	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	328	51
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	-	-
Total du passif	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	328	51
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,10	10,94
Classe B	9,10	10,94
Classe E	9,10	10,94
Classe F	9,10	10,94
Classe G	9,10	10,94
Classe I	9,40	11,13
Classe J	9,40	11,13
Classe L	9,40	11,13
Classe N	9,10	10,94

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	-	-
Non réalisé(e) sur les placements	(15)	1
Total gain net (perte nette)	(15)	1
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1	-
Frais d'administration	-	-
Frais de transactions	-	-
	1	-
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(16)	1
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,80)	0,22
Classe B	(1,81)	0,22
Classe E	(1,48)	0,22
Classe F	(1,66)	0,22
Classe G	(1,81)	0,22
Classe I	(1,69)	0,23
Classe J	(1,69)	0,23
Classe L	(1,69)	0,23
Classe N	(1,78)	0,22

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	51	-
Opérations sur les parts		
Parts émises	295	33
Parts rachetées	(2)	-
	293	33
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(16)	1
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	328	34

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(16)	1
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	15	(1)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(1)	-
Transactions de placements		
Acquisitions	(60)	(33)
Cessions	3	-
	(57)	(33)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(58)	(33)
Financement		
Parts émises	295	33
Parts rachetées	(2)	-
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	293	33
Variation nette de la trésorerie	235	-
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	-	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	235	-
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (28,35 %)				
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	3,97	444	16	13
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A	2,44	25	10	8
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	6,10	843	22	20
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	2,74	197	10	9
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	2,44	386	10	8
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	2,74	475	11	9
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	3,96	418	15	13
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	3,96	1 245	13	13
TOTAL DES PLACEMENTS (28,35 %)			107	93
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (71,65 %)				235
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				328

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Stratégie 100% actions se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Stratégie 100% actions est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Actions canadiennes (44 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (56 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust (page 114)	Fisher Investments
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	93	-	-	93
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	93	-	-	93

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	51	-	-	51
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	51	-	-	51

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	86 119	75 467
Trésorerie	116	-
Cession de placements à recevoir	-	684
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	86 235	76 151
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	707
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	31	23
Total du passif	31	730
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	86 204	75 421
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,91	14,51
Classe B	12,56	14,11
Classe C	13,01	14,62
Classe E	13,02	14,62
Classe F	12,95	14,54
Classe G	12,85	14,43
Classe I	15,68	17,38
Classe J	15,74	17,44
Classe N	13,01	14,62

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	165	1 082
Non réalisé(e) sur les placements	(10 030)	1 937
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	42	253
Total gain net (perte nette)	(9 823)	3 272
Distributions par le fonds sous-jacent	1 170	804
	(8 653)	4 076
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 112	1 025
Frais d'administration	41	37
Frais de transactions	-	-
	1 153	1 062
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(9 806)	3 014
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,58)	0,54
Classe B	(1,53)	0,53
Classe C	(1,59)	0,55
Classe E	(1,58)	0,55
Classe F	(1,58)	0,55
Classe G	(1,57)	0,54
Classe I	(1,65)	0,86
Classe J	(1,68)	0,87
Classe N	(1,58)	0,55

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	75 421	79 317
Opérations sur les parts		
Parts émises	32 301	5 456
Parts rachetées	(11 712)	(11 090)
	20 589	(5 634)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(9 806)	3 014
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	86 204	76 697

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(9 806)	3 014
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	9 865	(3 019)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 212)	(1 057)
	(1 153)	(1 062)
Transactions de placements		
Acquisitions	(24 469)	(1 590)
Cessions	5 848	8 171
	(18 621)	6 581
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	8	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(19 766)	5 517
Financement		
Parts émises	32 301	5 456
Parts rachetées	(11 712)	(11 090)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	20 589	(5 634)
Variation nette de la trésorerie	823	(117)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(707)	(101)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	116	(218)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,90 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	14,13	1 343 022	13 300	12 183
Fonds Obligations de sociétés CI, Catégorie I	8,07	749 656	7 990	6 945
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	12,04	829 401	11 628	10 377
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	10,06	721 249	9 352	8 672
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	16,24	1 165 596	16 134	13 999
Fonds Guardian Equity Income, Série I	7,96	325 381	5 927	6 859
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	5,91	172 711	5 490	5 098
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	5,92	217 256	4 737	5 104
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,87	71 718	3 122	3 340
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,89	172 305	2 983	3 357
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	2,94	81 379	2 428	2 532
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	2,95	240 132	2 548	2 546
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	5,92	416 025	5 484	5 107
TOTAL DES PLACEMENTS (99,90 %)			91 123	86 119
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,10 %)				85
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				86 204

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Celestia sécuritaire se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Celestia sécuritaire est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (60 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds Obligations de sociétés CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 114)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds Guardian Equity Income, Série I (page 114)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 114)	Gestion de Placements TD

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	86 119	-	-	86 119
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	86 119	-	-	86 119

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	75 467	-	-	75 467
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	75 467	-	-	75 467

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	97 334	110 188
Trésorerie	332	770
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	97 666	110 958
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	76	77
Total du passif	76	77
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	97 590	110 881
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,73	15,46
Classe B	13,45	15,13
Classe C	13,93	15,68
Classe E	13,93	15,68
Classe F	13,81	15,54
Classe G	13,63	15,33
Classe I	16,87	18,72
Classe J	16,96	18,82
Classe N	13,93	15,67

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	496	1 068
Non réalisé(e) sur les placements	(12 673)	6 594
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	143	369
Total gain net (perte nette)	(12 034)	8 031
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 189	1 039
	(10 844)	9 070
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 425	1 449
Frais d'administration	50	52
Frais de transactions	-	-
	1 475	1 501
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 319)	7 569
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,73)	1,00
Classe B	(1,69)	0,98
Classe C	(1,75)	1,02
Classe E	(1,75)	1,02
Classe F	(1,73)	1,01
Classe G	(1,71)	1,00
Classe I	(1,84)	1,43
Classe J	(1,85)	1,44
Classe N	(1,75)	1,02

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	110 881	110 701
Opérations sur les parts		
Parts émises	12 464	7 318
Parts rachetées	(13 436)	(18 586)
	(972)	(11 268)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 319)	7 569
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	97 590	107 002

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 319)	7 569
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	12 177	(7 662)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 332)	(1 408)
	(1 474)	(1 501)
Transactions de placements		
Acquisitions	(4 834)	(7 773)
Cessions	6 843	20 840
	2 009	13 067
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1)	(4)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	534	11 562
Financement		
Parts émises	12 464	7 318
Parts rachetées	(13 436)	(18 586)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(972)	(11 268)
Variation nette de la trésorerie	(438)	294
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	770	(220)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	332	74
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,74 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	8,09	870 519	8 681	7 896
Fonds Obligations de sociétés CI, Catégorie I	6,56	690 877	7 467	6 401
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	10,05	784 021	11 124	9 810
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	5,04	409 077	5 359	4 919
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	10,68	867 622	12 052	10 420
Fonds Guardian Equity Income, Série I	11,96	553 691	9 517	11 671
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	8,89	293 752	9 410	8 671
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	8,90	369 749	7 626	8 687
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,88	81 337	3 239	3 788
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,90	195 404	2 903	3 807
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	2,94	92 282	2 603	2 871
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	2,96	272 332	2 877	2 887
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	5,94	471 828	6 321	5 792
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	4,95	281 553	5 389	4 836
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	5,00	151 227	4 534	4 878
TOTAL DES PLACEMENTS (99,74 %)			99 102	97 334
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,26 %)				256
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				97 590

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Celestia équilibré se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Celestia équilibré est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (40 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds Obligations de sociétés CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 114)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (30 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds Guardian Equity Income, Série (page 114)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 114)	Gestion de Placements TD

Fonds spécialisés (10 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) (page 114)	Lazard Asset Management

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	97 334	-	-	97 334
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	97 334	-	-	97 334

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	110 188	-	-	110 188
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	110 188	-	-	110 188

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	42 346	45 747
Trésorerie	128	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	42 474	45 747
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	160
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	57	61
Total du passif	57	221
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	42 417	45 526
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,75	16,63
Classe B	14,48	16,33
Classe C	14,99	16,90
Classe E	15,01	16,92
Classe F	14,82	16,70
Classe G	14,58	16,43
Classe I	18,21	20,23
Classe J	18,33	20,37
Classe N	14,99	16,90

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	263	361
Non réalisé(e) sur les placements	(5 466)	3 366
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	66	193
Total gain net (perte nette)	(5 137)	3 920
Distributions par le fonds sous-jacent	471	391
	(4 666)	4 311
Charges		
Frais de gestion (note 6)	625	558
Frais d'administration	21	20
Frais de transactions	-	-
	646	578
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(5 312)	3 733
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,88)	1,39
Classe B	(1,84)	1,37
Classe C	(1,91)	1,41
Classe E	(1,91)	1,42
Classe F	(1,88)	1,40
Classe G	(1,86)	1,38
Classe I	(2,00)	1,92
Classe J	(2,03)	1,93
Classe N	(1,91)	1,42

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	45 526	40 641
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 669	3 700
Parts rachetées	(6 466)	(6 476)
	2 203	(2 776)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(5 312)	3 733
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	42 417	41 598

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(5 312)	3 733
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	5 203	(3 727)
Distributions par le fonds sous-jacent	(537)	(584)
	(646)	(578)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 994)	(3 781)
Cessions	2 729	7 661
	(1 265)	3 880
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(4)	(3)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(1 915)	3 299
Financement		
Parts émises	8 669	3 700
Parts rachetées	(6 466)	(6 476)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	2 203	(2 776)
Variation nette de la trésorerie	288	523
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(160)	(103)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	128	420
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,83 %)				
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F	5,59	261 126	2 601	2 369
Fonds Obligations de sociétés CI, Catégorie I	5,06	231 852	2 499	2 148
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	7,07	239 535	3 379	2 997
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	7,66	270 488	3 758	3 249
Fonds Guardian Equity Income, Série I	15,51	312 019	5 593	6 577
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	10,90	156 647	5 132	4 624
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	10,92	197 215	4 212	4 633
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	4,38	39 932	1 635	1 860
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	4,41	95 955	1 560	1 869
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	3,94	53 704	1 577	1 671
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	3,96	158 473	1 678	1 680
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	8,44	291 785	3 896	3 582
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	5,97	147 466	2 831	2 533
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	6,02	79 197	2 402	2 554
TOTAL DES PLACEMENTS (99,83 %)			42 753	42 346
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,17 %)				71
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				42 417

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Celestia croissance se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Celestia croissance est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (25 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds Obligations de sociétés CI, Catégorie I (114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (114)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (37,5 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds Guardian Equity Income, Série I (page 114)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (25,5 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité. Classe I (page 114)	GQG Partners LLC
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 114)	Gestion de Placements TD

Fonds spécialisés (12 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I, (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) (page 114)	Lazard Asset Management

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	42 346	-	-	42 346
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	42 346	-	-	42 346

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	45 747	-	-	45 747
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	45 747	-	-	45 747

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	27 380	32 291
Trésorerie	47	16
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	27 427	32 307
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	8	-
Autres créditeurs	83	89
Total du passif	91	89
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 336	32 218
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,27	17,28
Classe B	14,89	16,85
Classe C	15,49	17,53
Classe D	14,90	16,85
Classe E	15,52	17,56
Classe F	15,24	17,24
Classe G	14,89	16,84
Classe H	14,54	16,46
Classe I	18,88	21,05
Classe J	19,03	21,21
Classe N	15,49	17,53

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	333	490
Non réalisé(e) sur les placements	(3 838)	2 973
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	42	169
Total gain net (perte nette)	(3 463)	3 632
Distributions par le fonds sous-jacent	254	253
	(3 209)	3 885
Charges		
Frais de gestion (note 6)	422	416
Frais d'administration	14	15
Frais de transactions	-	-
	436	431
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 645)	3 454
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(2,00)	1,73
Classe B	(1,95)	1,69
Classe C	(2,03)	1,76
Classe D	(1,96)	1,69
Classe E	(2,03)	1,76
Classe F	(1,99)	1,73
Classe G	(1,95)	1,69
Classe H	(1,90)	1,65
Classe I	(2,15)	2,34
Classe J	(2,16)	2,36
Classe N	(2,03)	1,76

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	32 218	31 024
Opérations sur les parts		
Parts émises	2 044	1 801
Parts rachetées	(3 281)	(5 121)
	(1 237)	(3 320)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 645)	3 454
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	27 336	31 158

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 645)	3 454
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	3 505	(3 463)
Distributions par le fonds sous-jacent	(296)	(422)
	(436)	(431)
Transactions de placements		
Acquisitions	(862)	(3 294)
Cessions	2 572	7 258
	1 710	3 964
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(6)	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 268	3 531
Financement		
Parts émises	2 044	1 801
Parts rachetées	(3 281)	(5 121)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 237)	(3 320)
Variation nette de la trésorerie	31	211
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	16	(171)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	47	40
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,16 %)				
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	5,08	111 011	1 566	1 389
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	5,14	116 946	1 651	1 405
Fonds Guardian Equity Income, Série I	18,14	235 267	4 107	4 959
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	13,47	124 769	4 001	3 682
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	13,49	157 009	3 346	3 689
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	5,88	34 527	1 391	1 608
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	5,92	82 999	1 263	1 617
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	4,46	39 173	1 130	1 219
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	4,48	115 647	1 223	1 226
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	10,01	222 748	2 982	2 734
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	7,02	111 636	2 145	1 918
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	7,07	59 968	1 800	1 934
TOTAL DES PLACEMENTS (100,16 %)			26 605	27 380
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,16 %)				(44)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				27 336

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Celestia audacieux se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Celestia audacieux est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (10 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 114)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (45 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds Guardian Equity Income, Série I (page 114)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (31 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 114)	Gestion de Placements TD

Fonds spécialisés (14 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) (page 114)	Lazard Asset Management

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	27 380	-	-	27 380
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	27 380	-	-	27 380

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	32 291	-	-	32 291
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	32 291	-	-	32 291

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	599	292
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	10	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	609	292
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	6	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	-	-
Total du passif	6	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	603	292
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,55	10,83
Classe B	9,55	10,83
Classe E	9,55	10,83
Classe F	9,55	10,83
Classe G	9,55	10,83
Classe I	9,87	11,01
Classe J	9,87	11,01
Classe N	9,55	10,83

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(2)	-
Non réalisé(e) sur les placements	(58)	-
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1	-
Total gain net (perte nette)	(59)	-
Distributions par le fonds sous-jacent	4	-
	(55)	-
Charges		
Frais de gestion (note 6)	7	-
Frais d'administration	-	-
Frais de transactions	-	-
	7	-
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(62)	-
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,47)	0,12
Classe B	(1,47)	0,12
Classe E	(0,98)	0,12
Classe F	(1,00)	0,12
Classe G	(1,46)	0,12
Classe I	(1,33)	0,13
Classe J	(1,33)	0,13
Classe N	(1,50)	0,12

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	292	-
Opérations sur les parts		
Parts émises	404	34
Parts rachetées	(31)	-
	373	34
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(62)	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	603	34

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(62)	-
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	60	-
Distributions par le fonds sous-jacent	(5)	-
	(7)	-
Transactions de placements		
Acquisitions	(396)	(33)
Cessions	24	-
	(372)	(33)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(379)	(33)
Financement		
Parts émises	404	34
Parts rachetées	(31)	-
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	373	34
Variation nette de la trésorerie	(6)	1
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	-	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(6)	1
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,34 %)				
Fonds Guardian Equity Income, Série I	19,90	5 693	125	120
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	14,93	3 051	106	90
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	14,76	3 805	102	89
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	6,47	833	45	39
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	6,47	1 983	45	39
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	4,97	961	33	30
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	4,97	2 815	31	30
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	10,95	5 381	70	66
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	7,96	2 815	55	48
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	7,96	1 483	49	48
TOTAL DES PLACEMENTS (99,34 %)			661	599
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,66 %)				4
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				603

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veuillez vous référer aux pages indiquées au tableau de la page suivante.

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Celestia 100 % actions se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

Le Fonds SSQ Celestia 100 % actions est un fonds distinct qui investit exclusivement dans un ensemble de fonds sous-jacents ayant des approches de gestion complémentaires afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Actions canadiennes (50 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds Guardian Equity Income, Série (page 114)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 114)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 145)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (34 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 161)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 198)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A (page 114)	Corporation Fiera Capital
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I (page 114)	GQG Partners LLC
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 114)	Gestion de Placements TD

Fonds spécialisés (16 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) (page 114)	Lazard Asset Management

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	599	-	-	599
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	599	-	-	599

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	292	-	-	292
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	292	-	-	292

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE & FONDS SSQ CELESTIA

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

Au 30 juin 2022

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD</i>	%
AbbVie Inc.	2,15
Intl Business Machines Corp.	2,15
Broadcom Inc.	1,82
Philip Morris International Inc.	1,80
AstraZeneca PLC	1,78

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust</i>	%
Fair Isaac Corp.	3,50
Dominos Pizza Inc.	3,20
Ashtead Group PLC	3,10
Halozyne Therapeutics Inc.	2,90
SVB Financial Group	2,80

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds CI d'immobilier mondial, Catégorie I</i>	%
American Homes 4 Rent, Catégorie A	5,14
Prologis Inc.	4,33
Tricon Residential Inc.	4,04
Alexandria Real Estate Equities Inc.	3,83
Camden Property Trust REIT	3,82

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds CI obligations de sociétés, Catégorie I</i>	%
Sporting Life Group Ltd, Catégorie B	1,14
Fairfax India Holdings Corp., 5,00 % 26-02-2028	1,12
Dresdner Funding Trust I, 8,15 %, 30-06-2031	1,04
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-06-2032	0,87
General Electric Co., 5,00 %, 31-12-2049	0,80

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser</i>	%
Chemins de fer nationaux du Canada	8,00
Fonds d'actions spéciales Jarislowsky Fraser	7,40
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	6,10
Banque de Nouvelle-Écosse	6,00
Thomson Reuters Corp.	4,00

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Fannie Mae TBA, 3,50 %, 01-03-2052	7,64
Fannie Mae TBA, 4,00 %, 01-02-2052	4,95
Citigroup Mortgage Loan Trust, 0,00 %, 01-11-2061	2,55
Fannie Mae TBA, 4,00 %, 01-01-2052	2,17
Jamestown Residential DAC, 0,29 %, 24-06-2059	2,15

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A</i>	%
Park Lawn Corp.	3,52
Andlauer Healthcare Group Inc.	3,51
Uni-Select Inc.	3,28
Jamieson Wellness Inc.	3,26
Spartan Delta Corp.	3,23

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A</i>	%
Microsoft Corp.	6,90
Alphabet Inc., Catégorie A	6,75
Moody's Corp.	5,97
AutoZone Inc.	5,06
Johnson & Johnson	4,69

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I</i>	%
Exxon Mobil Corp.	6,30
AstraZeneca PLC	5,30
Occidental Petroleum Corp.	4,80
Microsoft Corp.	4,40
British American Tobacco PLC	4,20

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds ESG AlphaFixe RendementPlus, Catégorie F</i>	%
Fonds ESG Alphafixe - prêts bancaires à taux variable, Série F	36,44
Province de l'Ontario, 1,85 %, 01-02-2027	2,38
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	2,04
Hydro-Québec, 2,00 %, 01-09-2028	2,02
Province de Québec, 2,75 %, 01-09-2025	1,93

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Guardian Equity Income, Série I</i>	%
Banque Royale du Canada	6,60
Banque Toronto-Dominion	6,00
Canadian Natural Resources Ltd	5,00
Enbridge Inc.	4,70
Banque de Nouvelle-Écosse	4,20

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)</i>	%
Norfolk Southern Corp.	7,82
Ferrovial SA	7,74
National Grid PLC	7,39
Snam SpA	6,85
Vinci SA	5,76

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	20 013	24 495
Trésorerie	98	27
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	20 111	24 522
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	9	4
Total du passif	9	4
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 102	24 518
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,25	10,68
Classe B	8,89	10,26
Classe C	9,35	10,79
Classe E	9,36	10,81
Classe F	9,28	10,71
Classe G	9,19	10,60
Classe I	11,34	12,92
Classe J	13,14	14,96
Classe L	13,37	15,23
Classe N	9,35	10,80

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(21)	175
Non réalisé(e) sur les placements	(2 886)	732
Total gain net (perte nette)	(2 907)	907
Charges		
Frais de gestion (note 6)	280	310
Frais d'administration	11	12
Frais de transactions	-	-
	291	322
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 198)	585
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,42)	0,23
Classe B	(1,37)	0,23
Classe C	(1,44)	0,24
Classe E	(1,44)	0,24
Classe F	(1,43)	0,24
Classe G	(1,41)	0,24
Classe I	(1,56)	0,44
Classe J	(1,81)	0,51
Classe L	(1,85)	0,52
Classe N	(1,44)	0,24

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	24 518	25 442
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 364	3 359
Parts rachetées	(4 582)	(4 437)
	(1 218)	(1 078)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 198)	585
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	20 102	24 949

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 198)	585
Éléments sans incidence sur la trésorerie (Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 907	(907)
	(291)	(322)
Transactions de placements		
Acquisitions	(760)	(740)
Cessions	2 335	2 105
	1 575	1 365
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	5	1
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 289	1 044
Financement		
Parts émises	3 364	3 359
Parts rachetées	(4 582)	(4 437)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 218)	(1 078)
Variation nette de la trésorerie	71	(34)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	27	(1)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	98	(35)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,56 %)			
Guardian Managed Yield Portfolio Fund, Serie I	1 998 919	20 958	20 013
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,44 %)			89
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			20 102

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Guardian Managed Yield Portfolio Fund, Serie I</i>	%
Guardian Investment Grade Corp Bond Fund, Serie I	26,26
Guardian Canadian Bond Fund, Serie I	12,40
Guardian Global Dividend Growth Fund, Serie I	12,13
Guardian Strategic Income Fund, Serie X	8,16
Guardian Canadian Equity Fund, Serie I	6,35
Guardian Fundamental Global Equity Fund, Serie I	5,54
Guardian Canadian Equity Select Fund, Serie I	5,10
Guardian Canadian Equity Income Fund, Serie I	3,93
Guardian Directed Premium Yield, Serie I	3,77
Guardian Short Duration Bond Fund, Serie I	3,16

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu sécuritaire Guardian est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Guardian Managed Yield Portfolio, Série I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu sécuritaire Guardian se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Guardian Capital LP. Le gestionnaire utilise une stratégie de gestion qui intègre les approches de répartition de l'actif stratégique et tactique qui donnent la possibilité à celui-ci de profiter des opportunités de marché à mesure qu'elles surviennent. L'actif du fonds est composé d'environ 60 % de titres à revenu fixe et d'environ 40 % de titres à revenu variable.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	20 013	-	-	20 013
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	20 013	-	-	20 013

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	24 495	-	-	24 495
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	24 495	-	-	24 495

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	26 152	31 384
Trésorerie	-	152
Cession de placements à recevoir	125	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	26 277	31 536
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	101	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	10	12
Total du passif	111	12
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	26 166	31 524
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,80	11,42
Classe B	9,46	11,02
Classe C	9,97	11,62
Classe E	9,99	11,64
Classe F	9,86	11,49
Classe G	9,69	11,29
Classe I	12,12	13,93
Classe J	14,03	16,12
Classe L	14,30	16,44
Classe N	10,06	11,73

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	193	486
Non réalisé(e) sur les placements	(4 260)	1 645
Total gain net (perte nette)	(4 067)	2 131
Charges		
Frais de gestion (note 6)	369	399
Frais d'administration	14	15
Frais de transactions	-	-
	383	414
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(4 450)	1 717
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,62)	0,56
Classe B	(1,55)	0,55
Classe C	(1,65)	0,58
Classe E	(1,65)	0,58
Classe F	(1,62)	0,57
Classe G	(1,60)	0,56
Classe I	(1,80)	0,85
Classe J	(2,09)	0,98
Classe L	(2,13)	1,00
Classe N	(1,66)	0,58

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	31 524	32 769
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 488	4 865
Parts rachetées	(5 396)	(7 140)
	(908)	(2 275)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(4 450)	1 717
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	26 166	32 211

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(4 450)	1 717
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	4 067	(2 131)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(383)	(414)
Transactions de placements		
Acquisitions	(800)	(1 430)
Cessions	1 840	4 030
	1 040	2 600
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2)	2
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	655	2 188
Financement		
Parts émises	4 488	4 865
Parts rachetées	(5 396)	(7 140)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(908)	(2 275)
Variation nette de la trésorerie	(253)	(87)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	152	311
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(101)	224
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,95 %)			
Guardian Managed Income & Growth Portfolio Fund, Serie I	2 268 961	24 682	26 152
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,05 %)			14
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			26 166

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Guardian Managed Income & Growth Portfolio Fund, Serie I</i>	%
Guardian Global Dividend Growth Fund, Serie I	18,78
Guardian Investment Grade Corp Bond Fund, Serie I	14,68
Guardian Canadian Equity Fund, Serie I	14,31
Guardian Strategic Income Fund, Serie X	9,49
Guardian Fundamental Global Equity Fund, Serie I	8,80
Guardian Canadian Equity Income Fund, Serie I	6,23
Guardian Canadian Equity Select Fund, Serie I	5,96
Guardian Directed Premium Yield, Serie I	4,44
Guardian Emerging Markets Equity, Serie I	4,00
Guardian Canadian Bond Fund, Serie I	3,60

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu Guardian est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Guardian Managed Income & Growth Portfolio, Série I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu Guardian se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Guardian Capital LP. Le gestionnaire utilise une stratégie de gestion qui intègre les approches de répartition de l'actif stratégique et tactique qui donnent la possibilité à celui-ci de profiter des opportunités de marché à mesure qu'elles surviennent. L'actif du fonds est composé d'environ 40 % de titres à revenu fixe et d'environ 60 % de titres à revenu variable.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	26 152	-	-	26 152
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	26 152	-	-	26 152

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	31 384	-	-	31 384
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	31 384	-	-	31 384

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	60 011	74 515
Trésorerie	183	101
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	60 194	74 616
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	89	96
Total du passif	89	96
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	60 105	74 520
Valeur liquidative, par part		
Classe A	6,96	8,21
Classe B	6,81	8,03
Classe C	7,08	8,35
Classe E	7,11	8,38
Classe F	6,96	8,21
Classe G	6,78	7,99
Classe I	8,62	10,02
Classe J	10,07	11,71
Classe L	14,48	16,83
Classe N	7,08	8,35

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	356	828
Non réalisé(e) sur les placements	(14 258)	3 975
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	3 089	371
Total gain net (perte nette)	(10 813)	5 174
Distributions par le fonds sous-jacent	679	661
	(10 134)	5 835
Charges		
Frais de gestion (note 6)	821	930
Frais d'administration	31	35
Frais de transactions	-	-
	852	965
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(10 986)	4 870
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,25)	0,49
Classe B	(1,22)	0,47
Classe C	(1,27)	0,49
Classe E	(1,27)	0,50
Classe F	(1,24)	0,49
Classe G	(1,21)	0,48
Classe I	(1,40)	0,71
Classe J	(1,64)	0,83
Classe L	(2,35)	1,19
Classe N	(1,27)	0,49

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	74 520	77 386
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 575	4 885
Parts rachetées	(7 004)	(11 161)
	(3 429)	(6 276)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(10 986)	4 870
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	60 105	75 980

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(10 986)	4 870
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	13 902	(4 803)
Distributions par le fonds sous-jacent	(3 768)	(1 032)
	(852)	(965)
Transactions de placements		
Acquisitions	-	-
Cessions	4 370	7 320
	4 370	7 320
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(7)	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 511	6 353
Financement		
Parts émises	3 575	4 885
Parts rachetées	(7 004)	(11 161)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 429)	(6 276)
Variation nette de la trésorerie	82	77
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	101	(142)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	183	(65)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,84 %)			
Fonds catégorie de société canadienne de répartition de l'actif CI, Catégorie O	4 113 500	60 622	60 011
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,16 %)			94
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			60 105

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

Fonds catégorie de société canadienne de répartition de l'actif CI,

Catégorie O	%
Cambridge Canadian Core Plus Bond Pool, Catégorie I	34,09
Cambridge Canadian Short-Term Bond Pool, Catégorie I	3,14
Cambridge Canadian Long-Term Bond Pool, Catégorie I	3,06
SPDR Gold Shares	2,23
Elevance Health Inc.	1,73
McKesson Corp.	1,56
Visa Inc., Catégorie A	1,47
Microsoft Corp.	1,44
Canadian Natural Resources Ltd	1,37
Enbridge Inc.	1,31

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent catégorie de société canadienne de répartition de l'actif CI, Catégorie O. Par conséquent, le Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement du gestionnaire est de repérer des sociétés qui présentent une bonne valeur et des possibilités de croissance dans leur secteur d'activité. Il tient également compte de facteurs comme la pénétration du marché, les prévisions de bénéfices et la qualité de la direction.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	60 011	-	-	60 011
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	60 011	-	-	60 011

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	74 515	-	-	74 515
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	74 515	-	-	74 515

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	194 979	234 602
Trésorerie	-	682
Cession de placements à recevoir	1 140	-
Autres débiteurs	25	1
Total de l'actif	196 144	235 285
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	1 005	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	171	230
Total du passif	1 176	230
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	194 968	235 055
Valeur liquidative, par part		
Classe A	6,76	8,00
Classe B	6,59	7,80
Classe C	6,88	8,14
Classe E	6,90	8,17
Classe F	6,74	7,98
Classe G	6,56	7,76
Classe I	8,62	10,04
Classe J	10,36	12,07
Classe L	18,82	21,93
Classe N	6,87	8,14

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	761	252
Non réalisé(e) sur les placements	(39 686)	9 267
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	3 859	3 466
Total gain net (perte nette)	(35 066)	12 985
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 803	1 378
	(33 262)	14 363
Charges		
Frais de gestion (note 6)	2 875	2 714
Frais d'administration	94	89
Frais de transactions	-	-
	2 969	2 803
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(36 231)	11 560
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,24)	0,39
Classe B	(1,21)	0,38
Classe C	(1,26)	0,40
Classe E	(1,27)	0,40
Classe F	(1,23)	0,39
Classe G	(1,20)	0,38
Classe I	(1,42)	0,62
Classe J	(1,71)	0,75
Classe L	(3,10)	1,36
Classe N	(1,26)	0,40

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	235 055	194 770
Opérations sur les parts		
Parts émises	25 228	33 112
Parts rachetées	(29 084)	(23 772)
	(3 856)	9 340
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(36 231)	11 560
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	194 968	215 670

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(36 231)	11 560
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	38 925	(9 519)
Distributions par le fonds sous-jacent	(5 662)	(4 844)
	(2 968)	(2 803)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 155)	(8 230)
Cessions	8 375	2 015
	5 220	(6 215)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(83)	26
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	2 169	(8 992)
Financement		
Parts émises	25 228	33 112
Parts rachetées	(29 084)	(23 772)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 856)	9 340
Variation nette de la trésorerie	(1 687)	348
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	682	(218)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(1 005)	130
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,01 %)			
Fonds mondial de croissance et de revenu CI, Catégorie I	20 259 467	<u>188 003</u>	<u>194 979</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,01 %)			<u>(11)</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>194 968</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds mondial de croissance et de revenu CI, Catégorie I</i>	%
Titres du trésor des États-Unis, 0,38 %, 31-10-2023	4,24
Titres du trésor des États-Unis, 1,13 %, 31-10-2026	2,83
Titres du trésor des États-Unis, 1,88 %, 15-11-2051	2,05
Microsoft Corp.	2,04
Titres du trésor des États-Unis, 1,38 %, 15-11-2031	1,60
Apple Inc.	1,57
Shell PLC	1,56
Advanced Micro Devices Inc.	1,49
Alphabet Inc., Catégorie C	1,41
Cenovus Energy Inc.	1,26

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent mondial de croissance et de revenu CI, Catégorie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement combine une analyse macroéconomique descendante et une analyse de données fondamentales ascendante pour la sélection des titres.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	194 979	-	-	194 979
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	194 979	-	-	194 979

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	234 602	-	-	234 602
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	234 602	-	-	234 602

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	77 919	67 162
Trésorerie	1 020	-
Cession de placements à recevoir	-	155
Autres débiteurs	1	-
Total de l'actif	78 940	67 317
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	130
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	48	33
Total du passif	48	163
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	78 892	67 154
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,30	16,57
Classe B	15,84	16,11
Classe E	16,59	16,87
Classe F	16,23	16,50
Classe G	15,92	16,17
Classe I	19,73	19,80
Classe J	19,73	19,80
Classe L	16,41	16,47
Classe N	16,55	16,83

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	3 128	1 099
Non réalisé(e) sur les placements	(5 247)	11 185
Total gain net (perte nette)	(2 119)	12 284
Distributions par le fonds sous-jacent	1 321	1 043
	(798)	13 327
Charges		
Frais de gestion (note 6)	725	496
Frais d'administration	29	21
Frais de transactions	-	-
	754	517
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 552)	12 810
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,41)	2,91
Classe B	(0,39)	2,82
Classe E	(0,41)	2,97
Classe F	(0,40)	2,90
Classe G	(0,38)	2,84
Classe I	(0,21)	3,65
Classe J	(0,21)	3,63
Classe L	(0,18)	3,03
Classe N	(0,41)	2,97

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	67 154	62 166
Opérations sur les parts		
Parts émises	44 219	8 032
Parts rachetées	(30 929)	(18 489)
	13 290	(10 457)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 552)	12 810
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	78 892	64 519

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 552)	12 810
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 119	(12 284)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 321)	(1 043)
	(754)	(517)
Transactions de placements		
Acquisitions	(26 240)	(13 635)
Cessions	14 840	11 625
	(11 400)	(2 010)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	14	(4)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(12 140)	(2 531)
Financement		
Parts émises	44 219	8 032
Parts rachetées	(30 929)	(18 489)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	13 290	(10 457)
Variation nette de la trésorerie	1 150	(12 988)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(130)	12 870
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	1 020	(118)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (98,77 %)			
Fonds Guardian Equity Income, Série I	3 696 517	<u>69 959</u>	<u>77 919</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (1,23 %)			<u>973</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>78 892</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Guardian Equity Income, Série I</i>	%
Banque Royale du Canada	6,60
Banque Toronto-Dominion	6,00
Canadian Natural Resources Ltd	5,00
Enbridge Inc.	4,70
Banque de Nouvelle-Écosse	4,20
Banque de Montréal	4,00
TC Energy Corp.	3,80
Open text Corp.	3,80
Guardian Canadian Short Term Investment Fund, Série I	3,70
Suncor Energy Inc.	3,60

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions canadiennes dividendes Guardian est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Guardian Equity Income, Série I. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions canadiennes dividendes Guardian se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Guardian Capital LP selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion croissance et valeur à parts égales. Le gestionnaire privilégie les fiducies de revenu ainsi que les actions à rendement élevé rapportant des dividendes stables et prévisibles achetées à un prix raisonnable.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	77 919	-	-	77 919
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	77 919	-	-	77 919

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	67 162	-	-	67 162
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	67 162	-	-	67 162

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2022	31 décembre 2021
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	198 375	249 599
Trésorerie	470	678
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	198 845	250 277
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	114	139
Total du passif	114	139
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	198 731	250 138
Valeur liquidative, par part		
Classe A	26,75	32,80
Classe B	25,86	31,70
Classe D	25,85	31,70
Classe E	27,20	33,35
Classe F	26,55	32,55
Classe G	25,92	31,78
Classe H	25,12	30,80
Classe I	32,76	39,62
Classe J	32,76	39,62
Classe N	27,18	33,33

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	606	1 760
Non réalisé(e) sur les placements	(44 793)	35 737
Total gain net (perte nette)	(44 187)	37 497
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 966	2 704
	(42 220)	40 201
Charges		
Frais de gestion (note 6)	930	925
Frais d'administration	34	34
Frais de transactions	-	-
	964	959
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(43 184)	39 242
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(6,03)	4,08
Classe B	(5,83)	3,94
Classe D	(5,97)	3,92
Classe E	(6,13)	4,16
Classe F	(5,98)	4,06
Classe G	(5,84)	3,96
Classe H	(5,66)	3,84
Classe I	(6,83)	5,32
Classe J	(6,84)	5,31
Classe N	(6,13)	4,16

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	250 138	249 410
Opérations sur les parts		
Parts émises	16 422	19 844
Parts rachetées	(24 645)	(34 466)
	(8 223)	(14 622)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(43 184)	39 242
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	198 731	274 030

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(43 184)	39 242
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	44 187	(37 497)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 966)	(2 704)
	(963)	(959)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 092)	(2 106)
Cessions	12 095	18 290
	9 003	16 184
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(25)	12
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	8 015	15 237
Financement		
Parts émises	16 422	19 844
Parts rachetées	(24 645)	(34 466)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(8 223)	(14 622)
Variation nette de la trésorerie	(208)	615
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	678	(704)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	470	(89)
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,82 %)			
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	6 720 458	215 114	198 375
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,18 %)			356
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			198 731

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser</i>	%
Chemins de fer nationaux du Canada	8,00
Fonds d'actions spéciales Jarislowsky Fraser	7,40
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	6,10
Banque de Nouvelle-Écosse	6,00
Thomson Reuters Corp.	4,00
Groupe CGI Inc.	3,80
CCL Industries Inc. Catégorie B	3,70
Alimentation Couche-Tard Inc., Catégorie B	3,70
Goupe WSP Global Inc.	3,60
Intact Corporation Financière	3,60

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions canadiennes valeur Jarislowky Fraser Limitée est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent d'actions canadiennes Jarislowky Fraser. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions canadiennes valeur Jarislowky Fraser Limitée se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez-vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Jarislowky Fraser Limitée selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion majoritairement valeur. La philosophie du gestionnaire repose sur des principes conservateurs éprouvés de gestion de placements basés sur la recherche fondamentale.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	198 375	-	-	198 375
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	198 375	-	-	198 375

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	249 599	-	-	249 599
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	249 599	-	-	249 599

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	243 845	292 056
Trésorerie	16 709	19 952
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	692	710
Total de l'actif	261 246	312 718
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	104	101
Total du passif	104	101
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	261 142	312 617
Valeur liquidative, par part		
Classe A	19,18	21,67
Classe B	18,61	21,02
Classe D	18,56	20,96
Classe E	19,50	22,03
Classe F	19,12	21,59
Classe G	18,64	21,05
Classe H	18,02	20,36
Classe I	23,49	26,18
Classe J	23,49	26,18
Classe K	23,49	26,18
Classe L	14,29	15,92
Classe N	19,49	22,02

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	21 933	26 426
Non réalisé(e) sur les placements	(54 732)	25 623
Total gain net (perte nette)	(32 799)	52 049
Prêts de titres	75	59
Dividendes	4 176	3 314
Écart de conversion sur la trésorerie	(44)	(418)
	(28 592)	55 004
Charges		
Retenues d'impôts	5	5
Frais de gestion (note 6)	686	582
Frais d'administration	26	21
Frais de transactions	375	294
	1 092	902
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(29 684)	54 102
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(2,38)	3,05
Classe B	(2,31)	2,96
Classe D	(2,31)	2,94
Classe E	(2,42)	3,11
Classe F	(2,36)	3,05
Classe G	(2,30)	2,97
Classe H	(2,24)	2,87
Classe I	(2,53)	3,95
Classe J	(2,53)	3,92
Classe K	(2,53)	3,92
Classe L	(1,54)	2,42
Classe N	(2,42)	3,10

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	312 617	301 895
Opérations sur les parts		
Parts émises	28 274	20 305
Parts rachetées	(50 065)	(49 447)
	(21 791)	(29 142)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(29 684)	54 102
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	261 142	326 855

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(29 684)	54 102
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	44	418
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	32 799	(52 049)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	3 159	2 471
Transactions de placements		
Acquisitions	(143 576)	(91 803)
Cessions	158 988	118 039
	15 412	26 236
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	21	51
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	18 592	28 758
Financement		
Parts émises	28 274	20 305
Parts rachetées	(50 065)	(49 447)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(21 791)	(29 142)
Écart de conversion sur la trésorerie	(44)	(418)
Variation nette de la trésorerie	(3 243)	(802)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	19 952	4 765
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	16 709	3 963
Intérêts reçus	75	59
Dividendes reçus	4 245	3 351

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur		Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
ACTIONS (93,38 %)				ACTIONS (93,38 % (suite))			
ACTIONS CANADIENNES (88,17 %)				ACTIONS CANADIENNES (88,17 % (suite))			
Énergie (19,45 %)				Technologies de l'information (3,03 %)			
ARC Resources Ltd	483 000	6 274	7 839	Celestica Inc.	206 600	2 994	2 587
Birchcliff Energy Ltd	530 600	1 398	4 643	Constellation Software Inc.	2 790	5 875	5 331
Cameco Corp.	15 389	436	416			<u>8 869</u>	<u>7 918</u>
Canadian Natural Resources Ltd	93 900	2 862	6 495				
Enbridge Inc.	153 200	7 978	8 328	Services (3,98 %)			
Imperial Oil Ltd	115 150	5 647	6 987	Emera Inc.	45 300	2 855	2 732
TC Energy Corp.	39 300	2 747	2 621	Fortis Inc.	45 600	2 810	2 775
Tourmaline Oil Corp.	201 160	2 873	13 464	Hydro One Ltd	141 000	4 491	4 880
		<u>30 215</u>	<u>50 793</u>			<u>10 156</u>	<u>10 387</u>
				Immobilier (1,92 %)			
Matériaux de base (10,82 %)				Boardwalk REIT	27 700	1 499	1 160
Barrick Gold Corp.	262 800	6 542	5 981	Dream Industrial REIT UNITS	65 628	1 056	793
Franco-Nevada Corp.	17 600	3 158	2 980	DREAM Unlimited Corp., Catégorie A	62 000	2 801	1 975
Karora Resources Inc.	298 900	1 443	992	Tricon Capital Group Inc.	82 200	1 497	1 073
Methanex Corp.	44 100	2 783	2 168			<u>6 853</u>	<u>5 001</u>
Nutrien Ltd	75 800	5 251	7 770	TOTAL ACTIONS CANADIENNES		<u>204 034</u>	<u>230 241</u>
Teck Resources Ltd, Catégorie B	150 100	4 778	5 908				
Yamana Gold Inc.	411 500	2 812	2 465	ACTIONS AMÉRICAINES (0,97 %)			
		<u>26 767</u>	<u>28 264</u>	Technologies de l'information (0,97 %)			
				Microsoft Corp.	7 650	1 672	2 529
Produits industriels (2,93 %)				TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES		<u>1 672</u>	<u>2 529</u>
Calian Group Ltd	20 600	1 417	1 299				
Chemins de fer nationaux du Canada	19 845	3 201	2 873	ACTIONS INTERNATIONALES (4,24 %)			
Finning International Inc.	78 700	3 015	2 132	Produits industriels (2,25 %)			
Toromont Industries Ltd.	12 800	1 445	1 332	Elbit Systems Ltd	11 000	2 864	3 248
		<u>9 078</u>	<u>7 636</u>	Grupo Aeroportuario del Sureste SAB de CV	10 400	2 889	2 629
						<u>5 753</u>	<u>5 877</u>
Consommation discrétionnaire (3,94 %)				Soins de santé (1,11 %)			
Dollarama Inc.	80 100	5 547	5 937	GlaxoSmithKline PLC	51 900	2 889	2 908
Uni-Select Inc.	152 500	4 280	4 362				
		<u>9 827</u>	<u>10 299</u>	Services financiers (0,88 %)			
				Woori Financial Group Inc.	62 900	2 842	2 290
Consommation de base (7,00 %)				TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		<u>11 484</u>	<u>11 075</u>
Alimentation Couche-Tard Inc., Catégorie A	124 600	7 101	6 256				
Loblaw Cos Ltd	79 200	7 510	9 194	TOTAL DES PLACEMENTS (93,38 %)		<u>217 190</u>	<u>243 845</u>
Metro Inc.	41 100	2 829	2 840				
		<u>17 440</u>	<u>18 290</u>	AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (6,62 %)			<u>17 297</u>
				TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>261 142</u>
Services financiers (28,42 %)							
Banque de Montréal	101 200	9 713	12 527				
Banque de Nouvelle-Écosse	123 500	9 759	9 408				
Banque Royale du Canada	140 040	12 567	17 454				
Banque Toronto-Dominion	152 500	12 015	12 873				
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	113 000	7 942	6 470				
CIBC	80 310	4 203	5 020				
ECN Capital Corp.	491 800	2 840	2 710				
Financière Sun Life Inc.	57 400	4 140	3 385				
Intact Corporation financière	24 100	3 856	4 376				
		<u>67 035</u>	<u>74 223</u>				
Services de communication (6,68 %)							
BCE Inc.	115 900	7 516	7 333				
Rogers Communications Inc., Catégorie B NV	42 000	2 722	2 591				
TELUS Corp.	261 800	7 556	7 506				
		<u>17 794</u>	<u>17 430</u>				

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Objectif du Fonds

Le Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima (ci-après « Fonds ») a pour objectif d'obtenir une croissance du capital à long terme.

Stratégie de placement

Le Fonds est investi principalement dans des actions de sociétés canadiennes de grande capitalisation. Le Fonds peut détenir des parts de fonds correspondant aux titres précités.

La stratégie d'investissement du gestionnaire externe, Triasima Inc. Gestion de portefeuille, est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion majoritairement valeur. Il utilise l'analyse quantitative et qualitative pour la sélection des titres.

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, l'actif du Fonds est composé principalement d'actions canadiennes.

Risques présents

Le Fonds est exposé principalement au risque du marché boursier ainsi qu'aux risques associés à l'utilisation d'instruments financiers dérivés. Le Fonds ne recourt pas aux leviers financiers ni aux instruments financiers dérivés à des fins spéculatives.

Veillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers.

Risque de crédit

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, le Fonds ne détient pas de titres à revenu fixe. Par conséquent, il n'est pas exposé au risque de crédit.

Le Fonds peut participer à des opérations de prêts de titres. Au 30 juin 2022, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 51 672 \$ (59 023 \$ au 31 décembre 2021) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 52 714 \$ (60 206 \$ au 31 décembre 2021).

De plus, au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, aucun instrument financier dérivé n'était présent au Fonds.

Risque de liquidité

Le Fonds est exposé au risque de liquidité en raison des rachats quotidiens de parts. Les placements détenus au Fonds sont négociables sur un marché actif. Les titres de participation du Fonds sont inscrits à la cote des principales bourses. Ainsi, le Fonds est en mesure de liquider ses placements en fonction d'un montant qui se rapproche de leur juste valeur afin de respecter ses obligations de liquidité.

Risque de liquidité (suite)

Les tableaux suivants présentent les échéances des passifs financiers du Fonds d'après les durées restantes à courir jusqu'aux échéances contractuelles :

30 juin 2022	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	104	-	104

31 décembre 2021	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	101	-	101

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, le Fonds ne détient pas de titres à revenu fixe. Par conséquent, il n'est pas exposé au risque de taux d'intérêt.

Risque de prix

Le Fonds effectue des transactions d'actions canadiennes et de titres de marché monétaire qui doivent rencontrer les exigences de la politique de placement.

Le Fonds est composé majoritairement de titres négociables composant l'indice boursier canadien S&P/TSX. Le pourcentage des titres dans les émetteurs étrangers est limité à 10 % de l'actif du Fonds.

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation de son indice de référence d'actions canadiennes à grande capitalisation serait :

Variation (%)	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
+ 5	11 512	13 925
- 5	(11 512)	(13 925)

Les résultats de l'analyse de sensibilité du risque de prix au Fonds représentent la meilleure estimation de la direction. Les résultats réels pourraient différer de façon significative.

Risque de change

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, la majorité des titres du Fonds sont libellés en dollars canadiens, la devise fonctionnelle. Par conséquent, le Fonds est peu exposé au risque de change.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Risque de concentration

Le tableau suivant résume la répartition des titres en portefeuille selon les catégories de placement suivantes :

Catégories de placement	30 juin 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Actions canadiennes		
Énergie	19,45	12,23
Matériaux de base	10,82	9,35
Produits industriels	2,93	4,64
Consommation discrétionnaire	3,94	2,02
Consommation de base	7,00	3,00
Services financiers	28,42	40,81
Services de communication	6,68	2,07
Technologies de l'information	3,03	9,88
Services	3,98	0,79
Immobilier	1,92	4,30
Actions américaines		
Produits industriels	-	0,89
Services financiers	-	1,44
Technologies de l'information	0,97	1,54
Divers	-	0,46
Actions internationales		
Produits industriels	2,25	-
Soins de santé	1,11	-
Services financiers	0,88	-
Autres éléments d'actif net	6,62	6,58
Total	100,00	100,00

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	243 845	-	-	243 845
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	243 845	-	-	243 845

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	292 056	-	-	292 056
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	292 056	-	-	292 056

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	12 620	12 951
Trésorerie	115	36
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	15	-
Total de l'actif	12 750	12 987
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	11	10
Total du passif	11	10
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	12 739	12 977
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,67	18,73
Classe B	16,09	18,08
Classe D	16,27	18,28
Classe E	16,94	19,04
Classe F	16,55	18,59
Classe G	16,11	18,11
Classe H	15,65	17,59
Classe I	20,33	22,54
Classe J	20,44	22,66
Classe N	16,93	19,02

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	177	625
Non réalisé(e) sur les placements	(1 784)	1 259
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	58	-
Total gain net (perte nette)	(1 549)	1 884
Distributions par le fonds sous-jacent	168	223
	(1 381)	2 107
Charges		
Frais de gestion (note 6)	162	162
Frais d'administration	6	6
Frais de transactions	-	-
	168	168
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 549)	1 939
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(2,17)	2,49
Classe B	(2,10)	2,39
Classe D	(2,13)	2,41
Classe E	(2,20)	2,53
Classe F	(2,15)	2,47
Classe G	(2,10)	2,40
Classe H	(2,04)	2,33
Classe I	(2,31)	3,20
Classe J	(2,34)	3,02
Classe N	(2,21)	2,53

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	12 977	13 862
Opérations sur les parts		
Parts émises	2 991	1 148
Parts rachetées	(1 680)	(3 916)
	1 311	(2 768)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 549)	1 939
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	12 739	13 033

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 549)	1 939
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	1 607	(1 884)
Distributions par le fonds sous-jacent	(226)	(223)
	(168)	(168)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 840)	(190)
Cessions	790	3 130
	(1 050)	2 940
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(14)	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(1 232)	2 772
Financement		
Parts émises	2 991	1 148
Parts rachetées	(1 680)	(3 916)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	1 311	(2 768)
Variation nette de la trésorerie	79	4
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	36	32
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	115	36
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,07 %)			
Fonds BlackRock indiciel actions canadiennes, Classe D	261 372	10 941	12 620
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,93 %)			119
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			12 739

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock indiciel actions canadiennes, Classe D</i>	%
Banque Royale du Canada	6,40
Banque Toronto-Dominion	5,56
Enbridge Inc.	3,99
Banque de Nouvelle-Écosse	3,32
Chemins de fer nationaux du Canada	3,12
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	3,03
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	3,03
Banque de Montréal	3,01
Canadian Natural Resources Ltd	2,89
TC Energy Corp.	2,37

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Indice canadien BlackRock est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent BlackRock indiciel actions canadiennes, Classe D. Par conséquent, le Fonds SSQ Indice canadien BlackRock se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par BlackRock Asset Management et vise à reproduire l'indice composé S&P/TSX plafonné du marché boursier canadien.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	12 620	-	-	12 620
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	12 620	-	-	12 620

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	12 951	-	-	12 951
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	12 951	-	-	12 951

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	21 273	27 097
Trésorerie	-	81
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	15	-
Total de l'actif	21 288	27 178
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	60	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	10	14
Total du passif	70	14
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	21 218	27 164
Valeur liquidative, par part		
Classe A	21,56	27,15
Classe B	20,60	25,94
Classe E	21,94	27,62
Classe F	21,39	26,93
Classe G	20,82	26,22
Classe I	26,81	33,25
Classe J	26,81	33,25
Classe N	21,90	27,58

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	257	37
Non réalisé(e) sur les placements	(5 576)	3 008
Total gain net (perte nette)	(5 319)	3 045
Distributions par le fonds sous-jacent	112	-
	(5 207)	3 045
Charges		
Frais de gestion (note 6)	315	271
Frais d'administration	11	9
Frais de transactions	-	-
	326	280
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(5 533)	2 765
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(5,58)	2,93
Classe B	(5,33)	2,80
Classe E	(5,67)	2,99
Classe F	(5,52)	2,91
Classe G	(5,38)	2,84
Classe I	(6,45)	3,94
Classe J	(6,42)	3,93
Classe N	(5,66)	2,98

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	27 164	19 651
Opérations sur les parts		
Parts émises	2 942	5 145
Parts rachetées	(3 355)	(3 599)
	(413)	1 546
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(5 533)	2 765
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	21 218	23 962

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(5 533)	2 765
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	5 319	(3 045)
Distributions par le fonds sous-jacent	(112)	-
	(326)	(280)
Transactions de placements		
Acquisitions	(350)	(1 497)
Cessions	967	105
	617	(1 392)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(19)	1
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	272	(1 671)
Financement		
Parts émises	2 942	5 145
Parts rachetées	(3 355)	(3 599)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(413)	1 546
Variation nette de la trésorerie	(141)	(125)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	81	238
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(60)	113
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,26 %)			
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A	63 181	17 872	21 273
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,26 %)			(55)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			21 218

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", Catégorie A</i>	%
Park Lawn Corp.	3,52
Andlauer Healthcare Group Inc.	3,51
Uni-Select Inc.	3,28
Jamieson Wellness Inc.	3,26
Spartan Delta Corp.	3,23
Calian Group Ltd	3,09
Enerplus Corp.	3,00
StorageVault Canada Inc.	2,90
Cargojet Inc.	2,69
K92 Mining Inc.	2,42

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core", catégorie A. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante. Le gestionnaire utilise des styles de gestion croissance et valeur à parts égales. Il privilégie les entreprises canadiennes dont les perspectives de croissance des bénéfices sont supérieures à la moyenne.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	21 273	-	-	21 273
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	21 273	-	-	21 273

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	27 097	-	-	27 097
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	27 097	-	-	27 097

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	70 952	92 716
Trésorerie	-	186
Cession de placements à recevoir	443	-
Autres débiteurs	25	14
Total de l'actif	71 420	92 916
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	22	-
Achat de placements à payer	472	-
Autres créditeurs	30	43
Total du passif	524	43
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	70 896	92 873
Valeur liquidative, par part		
Classe A	32,94	39,98
Classe B	31,81	38,61
Classe E	33,50	40,66
Classe F	32,73	39,72
Classe G	31,92	38,74
Classe I	41,12	49,15
Classe J	40,61	48,54
Classe K	46,57	55,67
Classe L	13,94	16,67
Classe N	33,04	40,11

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 823	9 518
Non réalisé(e) sur les placements	(19 187)	4 472
Total gain net (perte nette)	(17 364)	13 990
Intérêts aux fins d'attribution	4	-
Prêts de titres	5	3
Dividendes	278	325
Distributions par le fonds sous-jacent	2 787	343
Écart de conversion sur la trésorerie	(14)	(17)
	(14 304)	14 644
Charges		
Retenues d'impôts	38	46
Frais de gestion (note 6)	193	146
Frais d'administration	7	5
Frais de transactions	25	37
	263	234
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(14 567)	14 410
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(6,95)	5,30
Classe B	(6,71)	5,12
Classe E	(7,06)	5,41
Classe F	(6,89)	5,27
Classe G	(6,73)	5,14
Classe I	(7,95)	6,99
Classe J	(7,83)	6,88
Classe K	(8,96)	7,90
Classe L	(2,68)	2,36
Classe N	(6,96)	5,32

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	92 873	82 027
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 456	3 951
Parts rachetées	(11 866)	(14 375)
	(7 410)	(10 424)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(14 567)	14 410
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	70 896	86 013

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(14 567)	14 410
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	14	17
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	17 364	(13 990)
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 787)	(343)
	24	94
Transactions de placements		
Acquisitions	(36 222)	(57 772)
Cessions	43 438	68 005
	7 216	10 233
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(24)	47
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	7 216	10 374
Financement		
Parts émises	4 456	3 951
Parts rachetées	(11 866)	(14 375)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(7 410)	(10 424)
Écart de conversion sur la trésorerie	(14)	(17)
Variation nette de la trésorerie	(208)	(67)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	186	179
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(22)	112
Intérêts reçus	9	3
Dividendes reçus	229	286

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, sauf le nombre d'actions et de parts)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur		Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
ACTIONS (66,94 %)				ACTIONS (66,94 %) (suite)			
ACTIONS AMÉRICAINES (64,72 %)				ACTIONS AMÉRICAINES (64,72 %) (suite)			
Énergie (2,85 %)				Soins de santé (16,30 %) (suite)			
APA Corp.	11 900	305	535	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1 400	236	508
ConocoPhillips	4 300	541	497	Viatrix Inc.	39 500	533	532
Marathon Oil Corp.	18 500	250	535			11 086	11 557
Marathon Petroleum Corp.	4 300	422	455				
		1 518	2 022	Services financiers (6,03 %)			
Matériaux de base (3,36 %)				Ameriprise Financial Inc.	1 500	583	459
Ashland Global Holdings Inc.	3 800	485	504	Discover Financial Services	3 600	500	438
CF Industries Holdings Inc.	4 900	322	541	FactSet Research System Inc.	1 100	570	545
Freeport-McMoRan Inc.	9 800	495	369	Loews Corp.	6 700	459	511
Louisiana-Pacific Corp.	6 900	540	466	Mgic Investment Corp.	28 700	565	466
Olin Corp.	8 400	503	500	The Hartford Financial Services Group Inc.	4 500	414	379
		2 345	2 380	Travelers Cos Inc.	2 300	534	501
Produits industriels (2,52 %)				Virtu Financial Inc., Catégorie A	12 000	516	362
Builders Firstsource Inc.	5 900	498	408	W.R. Berkley Corp.	7 000	428	615
CSX Corp.	12 700	474	475			4 569	4 276
Lockheed Martin Corp.	800	433	443	Services de communication (3,13 %)			
XPO Logistics Inc.	7 400	438	459	Alphabet Inc., Catégorie A	180	478	505
		1 843	1 785	Charter Communication Inc. Class A	800	464	483
Consommation discrétionnaire (4,49 %)				Electronic Arts Inc.	3 000	516	470
Airbnb Inc., Catégorie A	2 700	591	310	Meta Platforms Inc.	1 300	520	270
AutoNation Inc.	3 800	567	547	Playtika Holding Corp.	29 000	517	494
eBay Inc.	7 400	524	397			2 495	2 222
Expedia Group Inc.	1 900	492	232	Technologies de l'information (23,48 %)			
Tesla Inc.	500	494	433	Advanced Micro Devices Inc.	3 600	526	354
Toll Brothers Inc.	7 200	566	413	Allegro MicroSystems Inc.	17 600	471	469
Travel & Leisure Co.	8 100	490	405	Apple Inc.	3 200	69	563
Ulta Salon Cosmetics & Fragrance Inc.	900	442	447	Applied Materials Inc.	3 600	291	422
		4 166	3 184	Arista Networks Inc.	3 400	593	410
Consommation de base (1,30 %)				Arrow Electronics Inc.	3 300	351	476
The Hershey Co.	1 800	490	499	Broadcom Inc.	700	420	438
The Kroger Co.	6 900	498	420	Cadence Design Systems Inc.	2 800	128	541
		988	919	Crowdstrike Holdings Inc, Catégorie A	2 200	480	477
Soins de santé (16,30 %)				Datadog Inc.	3 900	495	478
AbbVie Inc.	2 700	519	532	DoubleVerify Holdings Inc.	18 100	517	528
Elevance Health Inc.	1 000	477	621	Dropbox Inc., Catégorie A	16 100	498	435
Bio-Techne Corp.	900	468	402	Dynatrace Inc.	10 200	497	518
Biogen Inc.	1 300	428	341	Fair Isaac Inc.	1 100	541	568
Bristol-Myers Squibb Co.	6 400	546	634	Fleetcor Technologies Inc.	1 900	571	514
Cigna Corp.	1 800	514	611	Gartner Inc.	1 600	443	498
Danaher Corp.	1 500	428	490	GoDaddy Inc., Catégorie A	5 500	563	493
Edwards Lifesciences Corp.	3 900	497	477	HP Inc.	11 400	342	481
Eli Lilly & Co.	1 200	370	501	Keysight Technologies Inc.	2 700	523	479
Exelixis Inc.	18 700	536	501	KLA-Tencor Corp.	1 300	495	534
Gilead Sciences Inc.	6 200	495	493	Manhattan Associates Inc.	3 100	535	457
McKesson Corp.	1 300	520	546	Microchip Technology Inc.	5 700	564	426
Merck & Co. Inc.	5 500	527	645	Microsoft Corp.	1 600	273	529
Mettler-Toledo International	300	466	444	Monolithic Power Systems Inc.	900	294	445
Moderna Inc.	1 600	302	294	NetApp Inc.	5 700	528	479
Molina Healthcare Inc.	1 600	599	576	NVIDIA Corp.	1 800	123	351
Pfizer Inc.	7 800	377	526	ON Semiconductor Corp.	8 800	408	570
Premier Inc., Catégorie A	11 900	548	547	Palo Alto Networks Inc.	800	509	509
Quidelortho Corp.	4 100	590	513	Paycom Software Inc.	1 300	583	469
Syneos Health Inc., Catégorie A	4 500	484	415	Paylocity Holdings Corp.	1 700	567	382
Veeva Systems Inc, Catégorie A	1 600	626	408	Pure Storage Inc.	15 300	608	506
				Qualcomm Inc.	2 500	578	411
				Synopsys Inc.	1 600	395	626
				Texas Instruments Inc.	1 900	401	376

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, sauf le nombre d'actions et de parts)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
ACTIONS (66,94 %) (suite)			
ACTIONS AMÉRICAINES (64,72 %) (suite)			
Technologies de l'information (23,48 %) (suite)			
Verisign Inc.	2 000	525	431
		<u>15 705</u>	<u>16 643</u>
Immobilier (1,26 %)			
SBA Communications Corp., Catégorie A	1 100	501	453
Weyerhaeuser Co.	10 400	501	443
		<u>1 002</u>	<u>896</u>
TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES		<u>45 717</u>	<u>45 884</u>
ACTIONS INTERNATIONALES (2,22 %)			
Services financiers (1,51 %)			
Chubb Ltd	2 100	540	531
Everest RE Group Ltd	1 500	574	541
		<u>1 114</u>	<u>1 072</u>
Technologies de l'information (0,71 %)			
Accenture PLC, Catégorie A	1 400	468	500
TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		<u>1 582</u>	<u>1 572</u>
TOTAL ACTIONS		<u>47 299</u>	<u>47 456</u>
		\$	\$
FOND DE PLACEMENTS (33,14 %)			
Hillsdale US Small Cap Equity Fund, Class Z	92 742	19 874	23 496
TOTAL DES PLACEMENTS (100,08 %)		<u>67 173</u>	<u>70 952</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,08 %)			<u>(56)</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>70 896</u>

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Objectif du Fonds

Le Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale (ci-après « Fonds ») a pour objectif d'obtenir une croissance du capital à long terme.

Stratégie de placement

Le Fonds est investi principalement dans des actions de sociétés américaines de grande capitalisation et peut également être investi dans des actions de sociétés américaines de petite capitalisation. Le Fonds peut détenir des parts de fonds correspondant aux titres précités.

La stratégie d'investissement du gestionnaire externe, Hillsdale Investment Management, est d'utiliser deux stratégies ayant des approches de gestion complémentaires. Une stratégie d'actions américaines à petite capitalisation (33 %) et une stratégie d'actions américaines « core » (67 %).

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, l'actif du Fonds est principalement composé d'actions américaines.

Risques présents

Le Fonds est exposé principalement au risque du marché incluant le risque de change entre le dollar canadien et le dollar américain ainsi qu'aux risques associés à l'utilisation d'instruments financiers dérivés. Le Fonds ne recourt pas aux leviers financiers ni aux instruments financiers dérivés à des fins spéculatives.

Veillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers.

Risque de crédit

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, le Fonds ne détient pas de titres à revenu fixe. Par conséquent, il n'est pas exposé au risque de crédit.

Le Fonds peut participer à des opérations de prêts de titres. Au 30 juin 2022, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 9 041 \$ (18 493 \$ au 31 décembre 2021) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 9 227 \$ (18 863 \$ au 31 décembre 2021).

De plus, au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021 aucun instrument financier dérivé n'était présent au Fonds.

Risque de liquidité

Le Fonds est exposé au risque de liquidité en raison des rachats quotidiens de parts. Les placements détenus au Fonds sont négociables sur un marché actif. Les titres de participation du Fonds sont inscrits à la cote des principales bourses. Ainsi, le Fonds est en mesure de liquider ses placements en fonction d'un montant qui se rapproche de leur juste valeur afin de respecter ses obligations de liquidité.

Risque de liquidité (suite)

Les tableaux suivants présentent les échéances des passifs financiers du Fonds d'après les durées restantes à courir jusqu'aux échéances contractuelles :

30 juin 2022	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	472	-	472
Autres crédateurs	30	-	30

31 décembre 2021	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	43	-	43

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, le Fonds ne détient pas de titres à revenu fixe. Par conséquent, il n'est pas exposé au risque de taux d'intérêt.

Risque de prix

Le Fonds effectue des transactions d'actions américaines qui doivent rencontrer les exigences de la politique de placement.

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation de son indice de référence d'actions américaines à grande capitalisation serait :

Variation (%)	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
+ 5	3 548	4 636
- 5	(3 548)	(4 636)

Les résultats de l'analyse de sensibilité du risque de prix au Fonds représentent la meilleure estimation de la direction. Les résultats réels pourraient différer de façon significative.

Risque de change

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, tous les titres du Fonds sont libellés en dollars américains.

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation du taux de change du dollar canadien serait :

Par rapport aux autres devises	Variation (%)	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
Dollar canadien	+ 5	(3 548)	(4 636)
	- 5	3 548	4 636

Les résultats de l'analyse de sensibilité du risque de change au Fonds représentent la meilleure estimation de la direction. Les résultats réels pourraient différer de façon significative.

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, aucun instrument financier de couverture de devise n'était présent au Fonds.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Risque de concentration

Le tableau suivant résume la répartition des titres en portefeuille selon les catégories de placement suivantes :

Catégories de placement	30 juin 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Actions américaines		
Énergie	2,85	2,26
Matériaux de base	3,36	2,82
Produits industriels	2,52	3,94
Consommation discrétionnaire	4,49	8,15
Consommation de base	1,30	-
Soins de santé	16,30	13,53
Services financiers	6,03	7,37
Services de communication	3,13	3,50
Technologies de l'information	23,48	22,76
Immobilier	1,26	-
Actions internationales		
Services financiers	1,51	0,67
Technologies de l'information	0,71	1,68
Fonds de placement		
Actions américaines	33,14	33,15
Autres éléments d'actif net	(0,08)	0,17
Total	100,00	100,00

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Actifs financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	47 456	-	-	47 456
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	23 496	-	-	23 496
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	70 952	-	-	70 952

31 décembre 2021				
Actifs financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	61 925	-	-	61 925
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	30 791	-	-	30 791
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	92 716	-	-	92 716

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	30 juin 2022	31 décembre 2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	39 867	33 791
Trésorerie	212	264
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	40 079	34 055
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	17	15
Total du passif	17	15
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	40 062	34 040
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,07	17,31
Classe B	15,52	16,71
Classe E	16,35	17,61
Classe F	15,98	17,20
Classe G	15,57	16,77
Classe I	19,91	21,12
Classe J	19,91	21,12
Classe N	16,33	17,58

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	86	289
Non réalisé(e) sur les placements	(2 585)	3 521
Total gain net (perte nette)	(2 499)	3 810
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
	(2 499)	3 811
Charges		
Frais de gestion (note 6)	522	440
Frais d'administration	18	15
Frais de transactions	-	-
	540	455
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 039)	3 356
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,33)	1,74
Classe B	(1,28)	1,68
Classe E	(1,34)	1,78
Classe F	(1,31)	1,73
Classe G	(1,28)	1,69
Classe I	(1,32)	2,39
Classe J	(1,32)	2,37
Classe N	(1,34)	1,77

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	34 040	29 808
Opérations sur les parts		
Parts émises	15 575	5 787
Parts rachetées	(6 514)	(5 861)
	9 061	(74)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 039)	3 356
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	40 062	33 090

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 039)	3 356
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 499	(3 810)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(540)	(454)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 280)	(1 301)
Cessions	1 705	2 300
	(8 575)	999
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(9 113)	543
Financement		
Parts émises	15 575	5 787
Parts rachetées	(6 514)	(5 861)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	9 061	(74)
Variation nette de la trésorerie	(52)	469
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	264	(332)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	212	137
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,51 %)			
Fonds d'actions américaines Beutel Goodman, Classe I	2 383 211	39 709	39 867
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,49 %)			195
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>40 062</u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds d'actions américaines Beutel Goodman, Classe I</i>	%
Amgen Inc.	6,10
Amdocs Ltd	5,70
Merck & Co. Inc.	5,68
Kimberly-Clark Corp.	4,97
Kellogg Co.	4,94
Campbell Soup Co.	4,82
Omnicom Group Inc.	4,39
NortonLifeLock Inc.	4,09
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	3,89
Harley-Davidson Inc.	3,73

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent d'actions américaines Beutel Goodman, Classe I. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Beutel Goodman selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion majoritairement valeur.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	39 867	-	-	39 867
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	39 867	-	-	39 867

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	33 791	-	-	33 791
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	33 791	-	-	33 791

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	109 782	154 035
Trésorerie	25	1 051
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	109 807	155 086
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	915
Autres créditeurs	76	80
Total du passif	76	995
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	109 731	154 091
Valeur liquidative, par part		
Classe A	19,49	24,09
Classe B	18,84	23,27
Classe D	18,98	23,45
Classe E	19,81	24,48
Classe F	19,38	23,93
Classe G	18,88	23,33
Classe H	18,30	22,61
Classe I	24,04	29,28
Classe J	24,05	29,29
Classe N	19,80	24,46

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	7 914	178
Non réalisé(e) sur les placements	(34 917)	13 606
Total gain net (perte nette)	(27 003)	13 784
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	675	-
	(26 327)	13 784
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 639	1 517
Frais d'administration	59	55
Frais de transactions	-	-
	1 698	1 572
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(28 025)	12 212
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(4,73)	2,03
Classe B	(4,57)	1,96
Classe D	(4,69)	1,97
Classe E	(4,82)	2,07
Classe F	(4,70)	2,03
Classe G	(4,58)	1,97
Classe H	(4,44)	1,91
Classe I	(5,41)	2,76
Classe J	(5,33)	2,75
Classe N	(4,81)	2,07

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	154 091	104 261
Opérations sur les parts		
Parts émises	20 078	25 864
Parts rachetées	(36 413)	(14 229)
	(16 335)	11 635
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(28 025)	12 212
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	109 731	128 108

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(28 025)	12 212
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	27 003	(13 784)
Distributions par le fonds sous-jacent	(675)	-
	(1 697)	(1 572)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 790)	(11 020)
Cessions	19 800	495
	17 010	(10 525)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(4)	9
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	15 309	(12 088)
Financement		
Parts émises	20 078	25 864
Parts rachetées	(36 413)	(14 229)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(16 335)	11 635
Variation nette de la trésorerie	(1 026)	(453)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	1 051	1 109
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	25	656
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,05 %)			
Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie A	5 399 235	<u>71 567</u>	<u>109 782</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,05 %)			<u>(51)</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>109 731</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie A</i>	%
Microsoft Corp.	9,80
Alphabet Inc., Catégorie A	7,81
UnitedHealth Group Inc.	6,46
Moody's Corp.	5,95
AutoZone Inc.	5,95
Johnson & Johnson	5,43
MasterCard Inc., Catégorie A	4,68
PepsiCo Inc.	4,37
Linde PLC	3,86
Lowe's Cos Inc.	3,80

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera actions américaines, Catégorie A. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion croissance à prix raisonnable.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	109 782	-	-	109 782
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	109 782	-	-	109 782

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	154 035	-	-	154 035
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	154 035	-	-	154 035

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2022	31 décembre 2021
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	23 214	31 237
Trésorerie	-	29
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	1	1
Total de l'actif	23 215	31 267
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	1	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	8	14
Total du passif	9	14
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	23 206	31 253
Valeur liquidative, par part		
Classe A	18,37	23,30
Classe B	17,92	22,74
Classe E	18,59	23,57
Classe F	18,29	23,20
Classe G	18,06	22,90
Classe I	21,93	27,41
Classe J	21,93	27,41
Classe N	18,54	23,52

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	700	113
Non réalisé(e) sur les placements	(6 957)	3 731
Total gain net (perte nette)	(6 257)	3 844
Distributions par le fonds sous-jacent	154	-
	(6 103)	3 844
Charges		
Frais de gestion (note 6)	333	287
Frais d'administration	12	10
Frais de transactions	-	-
	345	297
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(6 448)	3 547
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(4,94)	2,46
Classe B	(4,80)	2,40
Classe E	(5,00)	2,49
Classe F	(4,91)	2,45
Classe G	(4,86)	2,42
Classe I	(5,51)	3,15
Classe J	(5,50)	3,14
Classe N	(4,99)	2,48

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	31 253	23 931
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 629	5 909
Parts rachetées	(5 228)	(3 795)
	(1 599)	2 114
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(6 448)	3 547
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	23 206	29 592

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(6 448)	3 547
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	6 257	(3 844)
Distributions par le fonds sous-jacent	(154)	-
	(345)	(297)
Transactions de placements		
Acquisitions	(300)	(2 205)
Cessions	2 220	340
	1 920	(1 865)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(6)	2
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 569	(2 160)
Financement		
Parts émises	3 629	5 909
Parts rachetées	(5 228)	(3 795)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 599)	2 114
Variation nette de la trésorerie	(30)	(46)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	29	133
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(1)	87
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,03 %)			
Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie C	1 221 788	17 305	23 214
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,03 %)			(8)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			23 206

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie C</i>	%
Microsoft Corp.	9,80
Alphabet Inc., Catégorie A	7,81
UnitedHealth Group Inc.	6,46
Moody's Corp.	5,95
AutoZone Inc.	5,95
Johnson & Johnson	5,43
MasterCard Inc., Catégorie A	4,68
PepsiCo Inc.	4,37
Linde PLC	3,86
Lowe's Cos Inc.	3,80

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera Actions américaines, Catégorie C. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion croissance à prix raisonnable.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	23 214	-	-	23 214
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	23 214	-	-	23 214

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	31 237	-	-	31 237
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	31 237	-	-	31 237

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	47 364	71 986
Trésorerie	17	-
Cession de placements à recevoir	55	275
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	47 436	72 261
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	211
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	25	31
Total du passif	25	242
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	47 411	72 019
Valeur liquidative, par part		
Classe A	19,19	23,84
Classe B	18,53	23,02
Classe D	18,70	23,24
Classe E	19,55	24,28
Classe F	19,14	23,77
Classe G	18,63	23,14
Classe H	18,02	22,39
Classe I	23,60	28,90
Classe J	23,87	29,23
Classe N	19,50	24,22

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	5 334	1 538
Non réalisé(e) sur les placements	(17 544)	4 952
Total gain net (perte nette)	(12 210)	6 490
Distributions par le fonds sous-jacent	248	420
	(11 962)	6 910
Charges		
Frais de gestion (note 6)	653	719
Frais d'administration	23	27
Frais de transactions	-	-
	676	746
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 638)	6 164
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(4,75)	1,99
Classe B	(4,58)	1,92
Classe D	(4,66)	1,93
Classe E	(4,85)	2,03
Classe F	(4,72)	1,99
Classe G	(4,60)	1,93
Classe H	(4,45)	1,87
Classe I	(5,41)	2,70
Classe J	(5,47)	2,73
Classe N	(4,85)	2,02

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	72 019	57 240
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 716	11 287
Parts rachetées	(18 686)	(10 370)
	(11 970)	917
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 638)	6 164
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	47 411	64 321

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(12 638)	6 164
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	12 210	(6 490)
Distributions par le fonds sous-jacent	(248)	(420)
	(676)	(746)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 390)	(4 210)
Cessions	14 270	4 030
	12 880	(180)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(6)	1
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	12 198	(925)
Financement		
Parts émises	6 716	11 287
Parts rachetées	(18 686)	(10 370)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(11 970)	917
Variation nette de la trésorerie	228	(8)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(211)	15
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	17	7
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,90 %)			
Fonds BlackRock CAD indiciel actions ÉU, Classe D	1 368 956	32 837	47 364
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,10 %)			47
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			47 411

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock CAD indiciel actions ÉU, Classe D</i>	%
Apple Inc.	6,54
Microsoft Corp.	5,97
Amazon.com Inc.	2,89
Alphabet Inc., Catégorie A	2,04
Alphabet Inc., Catégorie C	1,88
Tesla Inc.	1,76
Berkshire Hathaway Inc., Catégorie B	1,54
UnitedHealth Group Inc.	1,50
Johnson & Johnson	1,45
NVIDIA Corp.	1,18

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Indice américain BlackRock est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent BlackRock CAD indiciel actions ÉU, Classe D. Par conséquent, le Fonds SSQ Indice américain BlackRock se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par BlackRock Asset Management et vise à reproduire l'indice S&P 500 du marché boursier américain.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	47 364	-	-	47 364
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	47 364	-	-	47 364

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	71 986	-	-	71 986
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	71 986	-	-	71 986

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	8 751	11 657
Trésorerie	30	24
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	20	-
Total de l'actif	8 801	11 681
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	5	7
Total du passif	5	7
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	8 796	11 674
Valeur liquidative, par part		
Classe A	7,42	10,60
Classe B	7,42	10,60
Classe E	7,42	10,60
Classe F	7,42	10,60
Classe G	7,42	10,60
Classe I	7,68	10,79
Classe J	7,90	11,09
Classe N	7,42	10,60

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	-	3
Non réalisé(e) sur les placements	(3 496)	534
Total gain net (perte nette)	(3 496)	537
Charges		
Frais de gestion (note 6)	16	-
Frais d'administration	-	-
Frais de transactions	-	-
	16	-
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 512)	537
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(3,17)	0,46
Classe B	(3,17)	0,46
Classe E	(2,97)	0,47
Classe F	(2,85)	0,46
Classe G	(2,60)	0,46
Classe I	(2,44)	0,63
Classe J	(3,19)	0,63
Classe N	(2,91)	0,46

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	11 674	-
Opérations sur les parts		
Parts émises	744	10 033
Parts rachetées	(110)	(35)
	634	9 998
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 512)	537
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	8 796	10 535

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 512)	537
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	3 496	(537)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(16)	-
Transactions de placements		
Acquisitions	(590)	(10 000)
Cessions	-	75
	(590)	(9 925)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(22)	7
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(628)	(9 918)
Financement		
Parts émises	744	10 033
Parts rachetées	(110)	(35)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	634	9 998
Variation nette de la trésorerie	6	80
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	24	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	30	80
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,49 %)			
Fisher Investments US Small Cap Core Equity ESG Unit Trust Fund	1 120 625	11 271	8 751
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,51 %)			45
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			8 796

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

Fisher Investments US Small Cap Core Equity ESG Unit Trust Fund

<i>Fund</i>	%
Pool Corporation	3,30
Paycom software Inc.	3,20
West Pharmaceutical Services Inc.	3,20
Darling Ingredients Inc.	2,80
SVB Financial Group	2,70
Cactus Inc., Catégorie A	2,60
Omniceil Inc.	2,60
Dominos Pizza Inc.	2,60
Medpace Holdings Inc.	2,40
Halozyne Therapeutics Inc.	2,40

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fisher Investments US Small Cap Core Equity ESG Unit Trust. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par Fisher Investments selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion descendante et un style de gestion majoritairement croissance.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	8 751	-	-	8 751
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	8 751	-	-	8 751

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	11 657	-	-	11 657
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	11 657	-	-	11 657

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	32 323	24 552
Trésorerie	65	61
Cession de placements à recevoir	55	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	32 443	24 613
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	12	9
Total du passif	12	9
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	32 431	24 604
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,09	10,27
Classe B	9,09	10,27
Classe E	9,09	10,27
Classe F	9,09	10,27
Classe G	9,09	10,27
Classe I	9,42	10,46
Classe J	10,23	11,36
Classe N	9,09	10,27

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	16	22
Non réalisé(e) sur les placements	(3 235)	1 713
Total gain net (perte nette)	(3 219)	1 735
Charges		
Frais de gestion (note 6)	115	-
Frais d'administration	3	-
Frais de transactions	-	-
	118	-
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 337)	1 735
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,19)	0,80
Classe B	(1,18)	0,78
Classe E	(1,18)	0,82
Classe F	(1,18)	0,78
Classe G	(1,18)	0,78
Classe I	(1,04)	0,96
Classe J	(1,15)	0,99
Classe N	(1,19)	0,78

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	24 604	14 363
Opérations sur les parts		
Parts émises	12 829	6 672
Parts rachetées	(1 665)	(527)
	11 164	6 145
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 337)	1 735
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	32 431	22 243

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 337)	1 735
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	3 219	(1 735)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(118)	-
Transactions de placements		
Acquisitions	(11 425)	(6 415)
Cessions	380	100
	(11 045)	(6 315)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	3	6
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(11 160)	(6 309)
Financement		
Parts émises	12 829	6 672
Parts rachetées	(1 665)	(527)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	11 164	6 145
Variation nette de la trésorerie	4	(164)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	61	2
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	65	(162)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,67 %)			
Fonds GQG Partners Actions internationales de qualité, Classe I	3 241 127	33 392	32 323
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,33 %)			108
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			32 431

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds GQG Partners Actions internationales de qualité, Classe I</i>	%
AstraZeneca PLC	6,00
British American Tobacco PLC	5,60
Philip Morris International Inc.	5,10
Petróleo Brasileiro SA	4,40
Enbridge Inc.	4,00
Total SA	4,00
Glencore PLC	3,60
HDFC Bank Ltd	3,10
Exxon Mobil Corp.	3,00
Roche Holding AG	2,50

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent GQG Partners Actions internationales de qualité, Classe I. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par GQG Partners LLC selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante, axée sur la sélection de titres et l'investissement à long terme.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	32 323	-	-	32 323
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	32 323	-	-	32 323

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	24 552	-	-	24 552
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	24 552	-	-	24 552

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	190 072	226 399
Trésorerie	3 495	4 785
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	158	31
Total de l'actif	193 725	231 215
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	102	109
Total du passif	102	109
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	193 623	231 106
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,33	19,72
Classe B	14,73	18,96
Classe D	8,55	11,01
Classe E	15,59	20,06
Classe F	15,20	19,56
Classe G	14,84	19,09
Classe H	8,55	11,01
Classe I	19,48	24,65
Classe J	19,48	24,65
Classe K	19,48	24,65
Classe L	12,94	16,37
Classe N	15,55	20,01

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(1 853)	9 392
Non réalisé(e) sur les placements	(50 344)	(6 753)
Total gain net (perte nette)	(52 197)	2 639
Intérêts aux fins d'attribution	(2)	(2)
Prêts de titres	11	2
Dividendes	2 467	2 320
Écart de conversion sur la trésorerie	(2)	1
	(49 723)	4 960
Charges		
Retenues d'impôts	230	282
Frais de gestion (note 6)	392	430
Frais d'administration	12	13
Frais de transactions	27	100
	661	825
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(50 384)	4 135
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(4,38)	0,11
Classe B	(4,21)	0,11
Classe D	(2,49)	0,06
Classe E	(4,45)	0,12
Classe F	(4,34)	0,11
Classe G	(4,24)	0,11
Classe H	(2,44)	0,06
Classe I	(5,15)	0,52
Classe J	(5,14)	0,52
Classe K	(5,13)	0,52
Classe L	(3,41)	0,34
Classe N	(4,42)	0,11

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	231 106	197 193
Opérations sur les parts		
Parts émises	32 528	31 630
Parts rachetées	(19 627)	(22 179)
	12 901	9 451
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(50 384)	4 135
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	193 623	210 779

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(50 384)	4 135
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	2	(1)
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	52 197	(2 639)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	1 815	1 495
Transactions de placements		
Acquisitions	(27 467)	(39 345)
Cessions	11 597	30 039
	(15 870)	(9 306)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(134)	20
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(14 189)	(7 791)
Financement		
Parts émises	32 528	31 630
Parts rachetées	(19 627)	(22 179)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	12 901	9 451
Écart de conversion sur la trésorerie	(2)	1
Variation nette de la trésorerie	(1 290)	1 661
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	4 785	2 273
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	3 495	3 934
Intérêts reçus	9	-
Dividendes reçus	2 110	2 014

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
ACTIONS INTERNATIONALES (98,17 %)			
Matériaux de base (4,17 %)			
Linde PLC	21 764	8 756	8 077
Produits industriels (18,07 %)			
Assa Abloy AB, Catégorie B	208 503	7 516	5 698
Atlas Copco AB, Catégorie A	349 656	4 345	4 203
Daikin Industries Ltd	34 500	6 564	7 120
Ferguson PLC	55 829	5 065	8 082
Siemens AG	46 435	7 746	6 107
Vinci SA	32 862	3 982	3 782
		<u>35 218</u>	<u>34 992</u>
Consommation discrétionnaire (7,80 %)			
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	8 777	7 162	6 916
Sony Corp.	77 800	5 540	8 190
		<u>12 702</u>	<u>15 106</u>
Consommation de base (11,48 %)			
Nestlé SA	51 968	5 206	7 806
Swedish Match AB	1 100 613	7 715	14 424
		<u>12 921</u>	<u>22 230</u>
Soins de santé (15,03 %)			
AstraZeneca PLC	52 918	7 015	9 004
Hoya Corp.	61 900	5 742	6 804
Novo Nordisk A/S, Catégorie B	93 157	5 480	13 293
		<u>18 237</u>	<u>29 101</u>
Services financiers (16,93 %)			
AIA Group Ltd	514 200	5 297	7 177
Bank Central Asia Tbk PT	9 378 800	5 402	5 848
Deutsche Boerse AG	28 173	6 144	6 091
HDFC Bank Ltd	193 030	9 519	13 657
		<u>26 362</u>	<u>32 773</u>
Technologies de l'information (17,45 %)			
Adyen NV	1 276	3 218	2 399
ASML Holding NV	15 011	5 820	9 270
Keyence Corp.	10 000	3 060	4 401
Samsung Electronics Co. Ltd	4 146	6 359	5 823
SAP SE	46 349	6 492	5 458
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	61 214	3 756	6 442
		<u>28 705</u>	<u>33 793</u>
Services (4,95 %)			
Iberdrola SA	272 893	4 619	3 658
SSE PLC	232 412	5 619	5 917
		<u>10 238</u>	<u>9 575</u>
Immobilier (2,29 %)			
Vonovia SE	111 114	7 809	4 425
TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		<u>160 948</u>	<u>190 072</u>
TOTAL DES PLACEMENTS (98,17 %)		<u>160 948</u>	<u>190 072</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (1,83 %)			<u>3 551</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>193 623</u>

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Objectif du Fonds

Le Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide (ci-après « Fonds ») a pour objectif d'obtenir une croissance du capital à long terme.

Stratégie de placement

Le Fonds est investi principalement dans des actions de sociétés internationales de grande capitalisation situées à l'extérieur de l'Amérique du Nord. Le Fonds peut détenir des parts de fonds correspondant aux titres précités.

La stratégie d'investissement du gestionnaire externe, C WorldWide Asset Management, est de favoriser une approche de gestion ascendante, axée sur la sélection de titres et l'investissement à long terme. Il utilise un style de gestion croissance à prix raisonnable. Il privilégie des entreprises ayant un fort pouvoir de fixation des prix et qui profitent de l'évolution de tendances économiques mondiales.

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, l'actif du Fonds est principalement composé d'actions internationales.

Risques présents

Le Fonds est exposé principalement au risque de prix, au risque de change entre le dollar canadien et les monnaies étrangères, au risque souverain ainsi qu'aux risques associés à l'utilisation d'instruments financiers dérivés. Le Fonds ne recourt pas aux leviers financiers ni aux instruments financiers dérivés à des fins spéculatives.

Veillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers.

Risque de crédit

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, le Fonds ne détient pas de titres à revenu fixe. Par conséquent, il n'est pas exposé au risque de crédit.

Le Fonds peut participer à des opérations de prêts de titres. Au 30 juin 2022, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 18 798 \$ (5 224 \$ au 31 décembre 2021) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 19 174 \$ (5 329 \$ au 31 décembre 2021).

De plus, au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, aucun instrument financier dérivé n'était présent au Fonds.

Risque de liquidité

Le Fonds est exposé au risque de liquidité en raison des rachats quotidiens de parts. Les placements détenus au Fonds sont négociables sur un marché actif. Les titres de participation du Fonds sont inscrits à la cote des principales bourses. Ainsi, le Fonds est en mesure de liquider ses placements en fonction d'un montant qui se rapproche de leur juste valeur afin de respecter ses obligations de liquidité.

Risque de liquidité (suite)

Les tableaux suivants présentent les échéances des passifs financiers du Fonds d'après les durées restantes à courir jusqu'aux échéances contractuelles :

30 juin 2022	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	102	-	102

31 décembre 2021	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	109	-	109

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, le Fonds ne détient pas de titres à revenu fixe. Par conséquent, il n'est pas exposé au risque de taux d'intérêt.

Risque de prix

Le Fonds effectue des transactions d'actions internationales et de titres de marché monétaire qui doivent rencontrer les exigences de la politique de placement. Le Fonds investit de 80 % à 100 % dans des actions internationales et jusqu'à un maximum de 20 % dans des titres de marché monétaire.

L'actif du Fonds doit être investi dans au moins cinq secteurs de l'indice MSCI EAEO. Un maximum de 30 % de l'actif du Fonds ne peut être investi dans des titres de sociétés qui font partie d'un même secteur. La capitalisation des sociétés visées doit être supérieure à 1 milliard \$ sans être inférieure à la société ayant la plus faible capitalisation de l'indice MSCI EAEO. L'exposition aux pays émergents est limitée à 30 % de l'actif du Fonds. Le pourcentage des titres d'un même émetteur est limité à 10 % de l'actif du Fonds.

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation de son indice de référence d'actions internationales à grande capitalisation serait :

Variation (%)	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
+ 5	9 504	11 320
- 5	(9 504)	(11 320)

Les résultats de l'analyse de sensibilité du risque de prix au Fonds représentent la meilleure estimation de la direction. Les résultats réels pourraient différer de façon significative.

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Risque de change

Le tableau suivant donne l'exposition du Fonds aux devises en présentant les placements à la juste valeur classés selon les monnaies étrangères :

Devises	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
Couronne danoise	13 293	12 407
Couronne suédoise	24 324	25 251
Dollar américain	25 922	31 891
Dollar de Hong Kong	7 177	6 206
Euro	56 184	71 510
Franc suisse	7 806	8 599
Livre sterling	23 004	25 477
Roupie indonésienne	5 848	5 762
Yen japonais	26 514	39 296
Total	190 072	226 399

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation possible du taux de change du dollar canadien serait :

Par rapport aux autres devises	Variation (%)	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
Dollar canadien	+ 5	(9 504)	(11 320)
	- 5	9 504	11 320

Les résultats de l'analyse de sensibilité du risque de change au Fonds représentent la meilleure estimation de la direction. Les résultats réels pourraient différer de façon significative.

Au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, aucun instrument financier de couverture de devise n'était présent au Fonds.

Risque de concentration

Le tableau suivant résume la répartition des titres en portefeuille selon les catégories de placement suivantes :

Catégories de placement	30 juin 2022 (%)	31 décembre 2021 (%)
Actions internationales		
Matériaux de base	4,17	-
Produits industriels	18,07	21,51
Consommation discrétionnaire	7,80	8,75
Consommation de base	11,48	13,80
Soins de santé	15,03	13,29
Services financiers	16,93	14,06
Technologies de l'information	17,45	20,26
Services	4,95	4,36
Immobilier	2,29	1,93
Autres éléments d'actif net	1,83	2,04
Total	100,00	100,00

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

Instruments financiers	30 juin 2022			Total (\$)
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	
Obligations	-	-	-	-
Actions	190 072	-	-	190 072
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	190 072	-	-	190 072

Instruments financiers	31 décembre 2021			Total (\$)
	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	
Obligations	-	-	-	-
Actions	226 399	-	-	226 399
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	226 399	-	-	226 399

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	10 706	19 200
Trésorerie	74	1 794
Cession de placements à recevoir	-	35
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	10 780	21 029
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	30	-
Autres créditeurs	8	1 740
Total du passif	38	1 740
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	10 742	19 289
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,33	15,21
Classe B	11,86	14,63
Classe D	11,97	14,77
Classe E	12,55	15,48
Classe F	12,21	15,07
Classe G	11,90	14,68
Classe H	11,56	14,26
Classe I	15,45	18,76
Classe J	15,45	18,76
Classe N	12,52	15,45

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	511	2 667
Non réalisé(e) sur les placements	(3 504)	611
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	-	277
Total gain net (perte nette)	(2 993)	3 555
Distributions par le fonds sous-jacent	204	945
	(2 789)	4 500
Charges		
Frais de gestion (note 6)	95	131
Frais d'administration	3	5
Frais de transactions	-	-
	98	136
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 887)	4 364
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(2,76)	0,58
Classe B	(2,65)	0,56
Classe D	(2,70)	0,56
Classe E	(2,81)	0,59
Classe F	(2,73)	0,58
Classe G	(2,66)	0,56
Classe H	(2,58)	0,54
Classe I	(3,16)	0,97
Classe J	(3,21)	0,97
Classe N	(2,80)	0,59

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	19 289	88 262
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 500	4 224
Parts rachetées	(9 160)	(20 501)
	(5 660)	(16 277)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 887)	4 364
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	10 742	76 349

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 887)	4 364
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 993	(3 278)
Distributions par le fonds sous-jacent	(204)	(1 222)
	(98)	(136)
Transactions de placements		
Acquisitions	(915)	(3 920)
Cessions	6 685	22 220
	5 770	18 300
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1 732)	(3)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 940	18 161
Financement		
Parts émises	3 500	4 224
Parts rachetées	(9 160)	(20 501)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(5 660)	(16 277)
Variation nette de la trésorerie	(1 720)	1 884
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	1 794	(1 081)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	74	803
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,66 %)			
Fonds BlackRock CAD indiciel actions MSCI EAEO, Classe D	540 557	<u>11 096</u>	<u>10 706</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,34 %)			<u>36</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>10 742</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock CAD indiciel actions MSCI EAEO, Classe D</i>	%
Nestlé SA	2,37
Roche Holding AG	1,69
AstraZeneca PLC	1,47
Shell PLC	1,43
ASML Holding NV	1,40
Novo Nordisk A/S, Catégorie B	1,35
Novartis AG	1,34
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1,22
Toyota Motor Corp.	1,19
BHP Group LTD	1,04

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Indice international BlackRock est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent BlackRock CAD indiciel actions MSCI EAEO, Classe D. Par conséquent, le Fonds SSQ Indice international BlackRock se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par BlackRock Asset Management et vise à reproduire l'indice boursier international MSCI EAEO.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	10 706	-	-	10 706
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	10 706	-	-	10 706

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	19 200	-	-	19 200
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	19 200	-	-	19 200

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	22 213	29 386
Trésorerie	64	-
Cession de placements à recevoir	-	145
Autres débiteurs	1	-
Total de l'actif	22 278	29 531
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	56
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	21	11
Total du passif	21	67
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	22 257	29 464
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,12	15,30
Classe B	13,54	14,66
Classe E	14,37	15,56
Classe F	14,09	15,25
Classe G	13,68	14,82
Classe I	17,83	19,00
Classe J	17,83	19,00
Classe L	14,54	15,49
Classe N	14,34	15,53

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(207)	(37)
Non réalisé(e) sur les placements	(1 808)	428
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	-	1 431
Total gain net (perte nette)	(2 015)	1 822
Distributions par le fonds sous-jacent	524	570
	(1 491)	2 392
Charges		
Frais de gestion (note 6)	266	232
Frais d'administration	9	7
Frais de transactions	-	-
	275	239
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 766)	2 153
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,07)	0,99
Classe B	(1,02)	0,96
Classe E	(1,09)	1,01
Classe F	(1,06)	1,00
Classe G	(1,04)	0,97
Classe I	(1,04)	1,48
Classe J	(1,05)	1,48
Classe L	(0,85)	1,21
Classe N	(1,09)	1,01

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	29 464	26 358
Opérations sur les parts		
Parts émises	5 363	3 718
Parts rachetées	(10 804)	(3 776)
	(5 441)	(58)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 766)	2 153
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	22 257	28 453

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 766)	2 153
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 015	(391)
Distributions par le fonds sous-jacent	(524)	(2 001)
	(275)	(239)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 440)	(1 510)
Cessions	9 267	2 245
	5 827	735
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	9	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	5 561	496
Financement		
Parts émises	5 363	3 718
Parts rachetées	(10 804)	(3 776)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(5 441)	(58)
Variation nette de la trésorerie	120	438
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(56)	(39)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	64	399
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,80 %)			
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	1 809 378	24 274	22 213
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,20 %)			44
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			22 257

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD</i>	%
AbbVie Inc.	2,15
Intl Business Machines Corp.	2,15
Broadcom Inc.	1,82
Philip Morris International Inc.	1,80
AstraZeneca PLC	1,78
Total Energies SE	1,78
Microsoft Corp.	1,73
Deutsche Telekom AG	1,67
Novartis AG	1,65
British American Tobacco PLC	1,63

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales dividendes TD est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Gestion commune mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales dividendes TD se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Gestion de Placements TD selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion majoritairement valeur.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	22 213	-	-	22 213
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	22 213	-	-	22 213

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	29 386	-	-	29 386
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	29 386	-	-	29 386

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	197 559	284 064
Trésorerie	116	327
Cession de placements à recevoir	-	1 040
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	197 675	285 431
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	125	1 889
Total du passif	125	1 889
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	197 550	283 542
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,88	21,57
Classe B	16,32	20,85
Classe D	9,84	12,57
Classe E	17,12	21,87
Classe F	16,86	21,54
Classe G	16,47	21,04
Classe H	9,84	12,57
Classe I	21,20	26,61
Classe J	21,28	26,71
Classe L	14,89	18,70
Classe N	17,11	21,86

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	12 192	3 858
Non réalisé(e) sur les placements	(67 468)	19 317
Total gain net (perte nette)	(55 276)	23 175
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 461	1 571
	(53 814)	24 746
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 246	1 212
Frais d'administration	37	36
Frais de transactions	-	-
	1 283	1 248
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(55 097)	23 498
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(4,71)	1,54
Classe B	(4,56)	1,50
Classe D	(2,76)	0,90
Classe E	(4,80)	1,57
Classe F	(4,70)	1,55
Classe G	(4,59)	1,51
Classe H	(2,75)	0,90
Classe I	(5,47)	2,24
Classe J	(5,49)	2,25
Classe L	(3,82)	1,57
Classe N	(4,80)	1,57

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	283 542	205 378
Opérations sur les parts		
Parts émises	33 207	71 505
Parts rachetées	(64 102)	(42 936)
	(30 895)	28 569
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(55 097)	23 498
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	197 550	257 445

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(55 097)	23 498
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	55 276	(23 175)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 461)	(1 571)
	(1 282)	(1 248)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 180)	(42 925)
Cessions	43 910	16 325
	33 730	(26 600)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1 764)	34
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	30 684	(27 814)
Financement		
Parts émises	33 207	71 505
Parts rachetées	(64 102)	(42 936)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(30 895)	28 569
Variation nette de la trésorerie	(211)	755
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	327	(281)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	116	474
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,00 %)			
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	6 350 814	<u>165 059</u>	<u>197 559</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,00 %)			<u>(9)</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>197 550</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A</i>	%
Microsoft Corp.	6,90
Alphabet Inc., Catégorie A	6,75
Moody's Corp.	5,97
AutoZone Inc.	5,06
Johnson & Johnson	4,69
MasterCard Inc., Catégorie A	4,55
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	4,06
Nestlé SA	3,95
UnitedHealth Group Inc.	3,72
PepsiCo Inc.	3,41

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera Actions mondiales, Catégorie A. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion croissance à prix raisonnable.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	197 559	-	-	197 559
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	197 559	-	-	197 559

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	284 064	-	-	284 064
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	284 064	-	-	284 064

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	18 413	7 590
Trésorerie	146	270
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	18 559	7 860
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	275
Autres créditeurs	12	5
Total du passif	12	280
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	18 547	7 580
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,20	10,68
Classe B	10,20	10,68
Classe E	10,20	10,68
Classe F	10,21	10,68
Classe G	10,20	10,68
Classe I	10,58	10,88
Classe J	10,86	11,17
Classe N	10,24	10,72

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	17	-
Non réalisé(e) sur les placements	(394)	640
Total gain net (perte nette)	(377)	640
Distributions par le fonds sous-jacent	-	50
	(377)	690
Charges		
Frais de gestion (note 6)	24	5
Frais d'administration	1	-
Frais de transactions	-	-
	25	5
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(402)	685
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,42)	0,80
Classe B	(0,42)	0,80
Classe E	(0,42)	0,80
Classe F	(0,41)	0,83
Classe G	(0,42)	0,80
Classe I	(0,24)	0,98
Classe J	(0,25)	0,94
Classe N	(0,42)	0,76

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	7 580	6 670
Opérations sur les parts		
Parts émises	12 507	959
Parts rachetées	(1 138)	(550)
	11 369	409
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(402)	685
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	18 547	7 764

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(402)	685
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	377	(640)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	(50)
	(25)	(5)
Transactions de placements		
Acquisitions	(11 860)	(620)
Cessions	385	270
	(11 475)	(350)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	7	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(11 493)	(355)
Financement		
Parts émises	12 507	959
Parts rachetées	(1 138)	(550)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	11 369	409
Variation nette de la trésorerie	(124)	54
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	270	6
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	146	60
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,28 %)			
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	1 736 783	<u>18 387</u>	<u>18 413</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,72 %)			<u>134</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>18 547</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I</i>	%
Exxon Mobil Corp.	6,30
AstraZeneca PLC	5,30
Occidental Petroleum Corp.	4,80
Microsoft Corp.	4,40
British American Tobacco PLC	4,20
UnitedHealth Group Inc.	4,20
Philip Morris International Inc.	4,10
Johnson & Johnson	3,50
Exelon Corp.	3,10
Wal-Mart Inc.	3,10

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales GQG Partners est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales GQG Partners se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par GQG Partners LLC selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante, axée sur la sélection de titres et l'investissement à long terme.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	18 413	-	-	18 413
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	18 413	-	-	18 413

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	7 590	-	-	7 590
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	7 590	-	-	7 590

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2022	31 décembre 2021
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	93 795	115 457
Trésorerie	810	79
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	94 605	115 536
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	75	77
Total du passif	75	77
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	94 530	115 459
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,48	15,21
Classe B	10,48	15,21
Classe E	10,49	15,23
Classe F	10,50	15,24
Classe G	10,49	15,22
Classe I	11,62	16,58
Classe J	11,62	16,58
Classe N	10,48	15,21

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(31)	2 943
Non réalisé(e) sur les placements	(36 882)	5 083
Total gain net (perte nette)	(36 913)	8 026
Charges		
Frais de gestion (note 6)	296	323
Frais d'administration	9	10
Frais de transactions	-	-
	305	333
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(37 218)	7 693
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(4,81)	0,99
Classe B	(4,83)	0,99
Classe E	(4,82)	0,99
Classe F	(4,81)	1,00
Classe G	(4,80)	0,99
Classe I	(5,08)	1,30
Classe J	(5,02)	1,30
Classe N	(4,81)	0,99

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	115 459	90 858
Opérations sur les parts		
Parts émises	24 947	13 980
Parts rachetées	(8 658)	(18 894)
	16 289	(4 914)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(37 218)	7 693
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	94 530	93 637

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(37 218)	7 693
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	36 913	(8 026)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(305)	(333)
Transactions de placements		
Acquisitions	(19 055)	(6 203)
Cessions	3 804	12 455
	(15 251)	6 252
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2)	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(15 558)	5 917
Financement		
Parts émises	24 947	13 980
Parts rachetées	(8 658)	(18 894)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	16 289	(4 914)
Variation nette de la trésorerie	731	1 003
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	79	(997)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	810	6
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,22 %)			
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	4 931 862	115 298	93 795
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,78 %)			735
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			94 530

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust</i>	%
Fair Isaac Corp.	3,50
Dominos Pizza Inc.	3,20
Ashtead Group PLC	3,10
Halozyme Therapeutics Inc.	2,90
SVB Financial Group	2,80
ON Semiconductor Corp.	2,70
HubSpot Inc.	2,60
Charles River Laboratories Inc.	2,20
Medpace Holdings Inc.	2,20
MKS Instruments Inc.	2,10

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Fisher est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Fisher se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Fisher Investments selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion descendante et un style de gestion majoritairement croissance.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	93 795	-	-	93 795
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	93 795	-	-	93 795

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	115 457	-	-	115 457
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	115 457	-	-	115 457

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	81 264	86 484
Trésorerie	701	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	20	-
Total de l'actif	81 985	86 484
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	148
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	53	55
Total du passif	53	203
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	81 932	86 281
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,73	13,95
Classe B	10,11	13,14
Classe E	10,93	14,20
Classe F	10,67	13,85
Classe G	10,36	13,46
Classe I	14,13	18,01
Classe J	13,94	17,77
Classe L	10,04	12,80
Classe N	10,75	13,97

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2	2 867
Non réalisé(e) sur les placements	(20 325)	(188)
Total gain net (perte nette)	(20 323)	2 679
Charges		
Frais de gestion (note 6)	170	249
Frais d'administration	4	7
Frais de transactions	-	-
	174	256
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(20 497)	2 423
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(3,21)	0,11
Classe B	(3,04)	0,10
Classe E	(3,27)	0,11
Classe F	(3,20)	0,12
Classe G	(3,10)	0,11
Classe I	(3,87)	0,54
Classe J	(3,79)	0,53
Classe L	(2,74)	0,38
Classe N	(3,18)	0,11

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	86 281	99 724
Opérations sur les parts		
Parts émises	22 118	20 413
Parts rachetées	(5 970)	(19 575)
	16 148	838
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(20 497)	2 423
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	81 932	102 985

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(20 497)	2 423
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	20 323	(2 679)
	(174)	(256)
Transactions de placements		
Acquisitions	(16 630)	(11 595)
Cessions	1 527	12 000
	(15 103)	405
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(22)	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(15 299)	147
Financement		
Parts émises	22 118	20 413
Parts rachetées	(5 970)	(19 575)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	16 148	838
Variation nette de la trésorerie	849	985
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(148)	(764)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	701	221
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,18 %)			
Fisher Investments Emerging Markets Equity Unit Trust Fund	7 986 501	<u>98 591</u>	<u>81 264</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,82 %)			<u>668</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>81 932</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fisher Investments Emerging Markets Equity Unit Trust Fund</i>	%
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	9,80
Tencent Holdings Ltd	7,00
Samsung Electronics Co. Ltd	6,30
Alibaba Group Holding Ltd	4,80
JD.com Inc	3,70
NAVER Corp.	3,70
Vale SA	3,30
Samsung Biologics Co. Ltd	3,10
Petroleo Brasileiro SA	3,10
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	2,80

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions marchés émergents Fisher est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fisher Investments Emerging Markets Equity Unit Trust Fund. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions marchés émergents Fisher se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Fisher Investments selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement du gestionnaire est de favoriser une combinaison des approches de gestion descendante et ascendante.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	81 264	-	-	81 264
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	81 264	-	-	81 264

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	86 484	-	-	86 484
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	86 484	-	-	86 484

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	98 547	119 652
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	1 075	1 590
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	99 622	121 242
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	910	643
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	57	1 379
Total du passif	967	2 022
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	98 655	119 220
Valeur liquidative, par part		
Classe A	17,71	18,10
Classe B	17,32	17,69
Classe E	18,05	18,44
Classe F	17,60	17,97
Classe I	22,63	22,74
Classe J	22,62	22,73
Classe L	13,53	13,60
Classe N	17,99	18,38

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	474	(71)
Non réalisé(e) sur les placements	(748)	7 454
Total gain net (perte nette)	(274)	7 383
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
	(273)	7 383
Charges		
Frais de gestion (note 6)	534	472
Frais d'administration	16	15
Frais de transactions	-	-
	550	487
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(823)	6 896
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,35)	1,12
Classe B	(0,33)	1,11
Classe E	(0,36)	1,15
Classe F	(0,34)	1,12
Classe I	(0,06)	1,71
Classe J	(0,06)	1,71
Classe L	(0,03)	1,02
Classe N	(0,36)	1,14

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	119 220	80 083
Opérations sur les parts		
Parts émises	15 300	12 597
Parts rachetées	(35 042)	(10 688)
	(19 742)	1 909
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(823)	6 896
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	98 655	88 888

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(823)	6 896
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	274	(7 383)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(549)	(487)
Transactions de placements		
Acquisitions	(4 611)	(4 727)
Cessions	25 957	3 045
	21 346	(1 682)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1 322)	5
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	19 475	(2 164)
Financement		
Parts émises	15 300	12 597
Parts rachetées	(35 042)	(10 688)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(19 742)	1 909
Variation nette de la trésorerie	(267)	(255)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(643)	949
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(910)	694
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,89 %)			
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	3 055 312	98 774	98 547
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,11 %)			108
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			98 655

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)</i>	%
Norfolk Southern Corp.	7,82
Ferrovial SA	7,74
National Grid PLC	7,39
Snam SpA	6,85
Vinci SA	5,76
Terna SpA	5,53
CSX Corp.	4,87
Pinnacle West Capital Corp.	4,66
Atlantia SpA	4,54
United Utilities Group PLC	4,26

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Infrastructures mondiales Lazard est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Lazard Global Listed Infrastructure (Canada). Par conséquent, le Fonds SSQ Infrastructures mondiales Lazard se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Lazard Asset Management selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion majoritairement valeur. Le gestionnaire privilégie les sociétés d'infrastructures oligopolistiques procurant un rendement élevé constant et possédant des infrastructures de longue durée.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	98 547	-	-	98 547
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	98 547	-	-	98 547

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	119 652	-	-	119 652
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	119 652	-	-	119 652

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin	31 décembre
Aux	2022	2021
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	9 916	6 757
Trésorerie	228	-
Cession de placements à recevoir	-	790
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	10 144	7 547
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	93
Achat de placements à payer	195	-
Autres créditeurs	2	695
Total du passif	197	788
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	9 947	6 759
Valeur liquidative, par part		
Classe A	8,89	11,34
Classe B	8,89	11,34
Classe E	8,89	11,34
Classe F	8,90	11,35
Classe I	9,22	11,56
Classe J	9,22	11,56
Classe L	9,22	11,56
Classe N	8,89	11,34

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(3)	-
Non réalisé(e) sur les placements	(2 344)	18
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	169	33
Total gain net (perte nette)	(2 178)	51
Distributions par le fonds sous-jacent	50	-
	(2 128)	51
Charges		
Frais de gestion (note 6)	74	5
Frais d'administration	2	-
Frais de transactions	-	-
	76	5
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 204)	46
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(2,82)	0,05
Classe B	(3,00)	0,05
Classe E	(2,81)	0,05
Classe F	(2,88)	0,05
Classe I	(2,63)	0,07
Classe J	(1,37)	0,07
Classe L	(2,70)	0,07
Classe N	(2,00)	0,05

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS INTERMÉDIAIRES (non audités)
(en milliers de dollars)

ÉTATS DE L'ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	6 759	-
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 030	7 827
Parts rachetées	(638)	(81)
	5 392	7 746
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 204)	46
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	9 947	7 792

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2022	2021
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 204)	46
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 347	(18)
Distributions par le fonds sous-jacent	(219)	(33)
	(76)	(5)
Transactions de placements		
Acquisitions	(5 440)	(7 735)
Cessions	1 138	-
	(4 302)	(7 735)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(693)	1
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(5 071)	(7 739)
Financement		
Parts émises	6 030	7 827
Parts rachetées	(638)	(81)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	5 392	7 746
Variation nette de la trésorerie	321	7
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(93)	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	228	7
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2022 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,69 %)			
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	577 281	11 327	9 916
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,31 %)			31
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			9 947

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I</i>	%
American Homes 4 Rent, Catégorie A	5,14
Prologis Inc.	4,33
Tricon Residential Inc.	4,04
Alexandria Real Estate Equities Inc.	3,83
Camden Property Trust REIT	3,82
American Tower Corp.	3,63
Switch Inc., Catégorie A	3,42
VICI Properties Inc.	3,38
Host Hotels & Resorts Inc.	2,98
AvalonBay Communities Inc.	2,93

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 et exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Immobilier mondial CI est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent d'immobilier mondial CI, Catégorie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Immobilier mondial CI se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 8 et 9 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion combinée ascendante et descendante.

Juste valeur des instruments financiers

Les tableaux suivants présentent les instruments financiers classés selon la hiérarchie des évaluations à la juste valeur décrite à la note 2 :

30 juin 2022				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	9 916	-	-	9 916
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	9 916	-	-	9 916

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	6 757	-	-	6 757
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	6 757	-	-	6 757

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2022 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES

Les Fonds SSQ (ci-après « Fonds ») sont des fonds distincts à capital variable constitués en vertu de la *Loi sur les assurances* du Québec et administrés par SSQ, Société d'assurance-vie inc. (ci-après la « Société »). Le siège social de la Société est situé au 2525, boulevard Laurier, Québec (Québec), Canada. L'actif net des Fonds est la propriété de la Société et est comptabilisé séparément de ses autres actifs. Les Fonds ne sont pas des entités juridiques distinctes de la Société.

La publication des états financiers des Fonds a été approuvée par la direction de la Société le 14 septembre 2022.

Au 30 juin 2022, les Fonds présents sont :

Fonds	Gestionnaires	Début des activités
Marché monétaire Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	1 ^{er} décembre 1997
Obligations court terme Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	25 septembre 2008
Obligations Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	16 juin 2009
Obligations PIMCO	PIMCO Canada	27 mai 2008
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe	AlphaFixe Capital	15 juin 2018
Obligations mondiales PIMCO	PIMCO Canada	13 janvier 2014
Obligations de sociétés CI	Gestion mondiale d'actifs CI	21 novembre 2016
Indice obligataire BlackRock	BlackRock Asset Management	4 juillet 2005
Portefeuille bêta intelligent plus – sécuritaire	Multiplés (page 43)	14 juin 2019
Portefeuille bêta intelligent plus – équilibré	Multiplés (page 48)	14 juin 2019
Portefeuille bêta intelligent plus – croissance	Multiplés (page 53)	14 juin 2019
Portefeuille bêta intelligent plus – audacieux	Multiplés (page 58)	14 juin 2019
Stratégie sécuritaire	Multiplés (page 64)	7 décembre 1998
Stratégie équilibrée	Multiplés (page 69)	1 ^{er} décembre 1997
Stratégie croissance	Multiplés (page 74)	7 décembre 1998
Stratégie audacieuse	Multiplés (page 79)	14 novembre 2005
Stratégie 100 % actions	Multiplés (page 84)	21 juin 2021
Celestia sécuritaire	Multiplés (page 89)	22 septembre 2008
Celestia équilibré	Multiplés (page 94)	22 septembre 2008
Celestia croissance	Multiplés (page 99)	22 septembre 2008
Celestia audacieux	Multiplés (page 104)	22 septembre 2008
Celestia 100 % actions	Multiplés (page 109)	21 juin 2021
Revenu sécuritaire Guardian	Guardian Capital LP	12 juin 2015
Revenu Guardian	Guardian Capital LP	12 juin 2015
Répartition d'actifs canadiens CI	Gestion mondiale d'actifs CI	9 juin 2014
Revenu et croissance mondial CI	Gestion mondiale d'actifs CI	9 juin 2014
Actions canadiennes dividendes Guardian	Guardian Capital LP	1 ^{er} juin 2012
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée	Jarislowsky Fraser Limitée	1 ^{er} novembre 2001
Actions canadiennes Triasima	Triasima Inc. Gestion de portefeuille	2 octobre 2006
Indice canadien BlackRock	BlackRock Asset Management	7 décembre 1998
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	1 ^{er} novembre 2001
Actions américaines Hillsdale	Hillsdale Investment Management	30 avril 2012
Actions américaines Beutel Goodman	Beutel Goodman	9 novembre 2015
Actions américaines Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	9 novembre 2015
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	21 novembre 2016
Indice américain BlackRock	BlackRock Asset Management	7 décembre 1998
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher	Fisher Investments	28 janvier 2021
Actions internationales GQG Partners	GQG Partners LLC	1 ^{er} octobre 2020
Actions internationales C WorldWide	C WorldWide Asset Management	9 juin 2008
Indice international BlackRock	BlackRock Asset Management	4 juillet 2005
Actions mondiales dividendes TD	Gestion de Placements TD	13 janvier 2014
Actions mondiales Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	31 mars 2016
Actions mondiales GQG Partners	GQG Partners LLC	1 ^{er} octobre 2020

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES (suite)

Fonds	Gestionnaires	Début des activités
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher	Fisher Investments	14 juin 2019
Actions marchés émergents Fisher	Fisher Investments	21 juillet 2011
Infrastructures mondiales Lazard	Lazard Asset Management	12 juin 2007
Immobilier mondial CI	Gestion mondiale d'actifs CI	21 juin 2021

Chacun des Fonds a été scindé en différentes classes de Fonds ayant chacune leur propre valeur unitaire et leur propre frais de gestion. Les différentes classes de Fonds offertes sont les suivantes :

Classes	Produits
A	Unité de FPG garantie option de base 75/100 offerte avant le 26 novembre 2012
B	Unité de FPG garantie option supérieur 100/100 offerte avant le 26 novembre 2012
C	Revenu garanti SSQ offert avant le 3 mai 2013
D	CIG Boursier offert avant le 26 novembre 2012
E	Unité de FPG garantie régulière 75/75 offerte depuis le 26 novembre 2012
F	Unité de FPG garantie enrichie 75/100 offerte depuis le 26 novembre 2012
G	Unité de FPG garantie optimale 100/100 offerte depuis le 26 novembre 2012
H	CIG Boursier offert depuis le 26 novembre 2012
I	Gestion privée (investissement de 500 000\$ et plus)
J	Clientèle institutionnelle
K	Interfonds
L	Clientèle institutionnelle spécialisée
N	Fonds collectifs

Modification à l'offre de Fonds

Depuis le 21 juin 2021, les Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners, SSQ Actions mondiales GQG Partners et SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher sont offerts à la clientèle visée par la notice explicative. Auparavant, ces Fonds n'étaient offerts qu'à la clientèle institutionnelle.

Fermeture de Fonds

Le Fonds suivant a été fermé et son actif net a été transféré au Fonds de destination indiqué ci-dessous, sauf si indication contraire des souscripteurs de parts :

Fonds fermé	Fonds de destination	Date de fermeture
Immobilier mondial Morgan Stanley	Immobilier mondial CI	21 juin 2021

Participation dans les Fonds

La Société détient des parts dans certains Fonds SSQ. Le tableau suivant présente les justes valeurs des soldes des investissements de la Société dans les Fonds concernés :

Fonds	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
Obligations PIMCO	205	197
Obligations mondiales PIMCO	1 399	1 433
Stratégie sécuritaire	4 313	4 911
Stratégie équilibrée	25 077	26 458
Stratégie croissance	16 933	18 362
Stratégie audacieuse	7 530	8 592
Revenu sécuritaire Guardian	460	524
Revenu Guardian	496	570
Répartition d'actifs canadiens CI	3 725	4 389
Revenu et croissance mondial CI	21 632	25 489
Actions Canadiennes Triasima	322	281
Actions canadiennes dividendes Guardian	4 125	3 752
Actions américaines Hillsdale	1 865	2 162

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES (suite)

Participation dans les Fonds (suite)

Fonds	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
Actions internationales C WorldWide	1 479	1 688
Actions mondiales dividendes TD	5 049	5 409
Actions mondiales Fiera Capital	4 326	4 545
Actions marchés émergents Fisher	339	327
Infrastructures mondiales Lazard	3 455	3 165
Immobilier mondial CI	752	905

De plus, au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, les régimes de retraite offerts aux employés de la Société détenaient des parts des Fonds.

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires (les « états financiers ») sont préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS ») en vigueur au 30 juin 2022 conformément à la norme IAS 34 « Information financière intermédiaire » telles que publiées par l'*International Accounting Standards Board* (« IASB ») et énoncées dans le Manuel de CPA Canada – Comptabilité.

Utilisation de jugements de la direction

La préparation d'états financiers conformément aux IFRS exige que la direction ait recours à son jugement pour établir des estimations et des hypothèses qui ont une incidence sur les montants de l'actif et du passif comptabilisés à la date des états financiers ainsi que sur les montants comptabilisés à titre de produits et de charges au cours de la période. Les résultats réels pourraient différer des résultats estimatifs.

La direction a établi que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement selon IFRS 10 « États financiers consolidés » puisqu'ils :

- Obtiennent des fonds d'un ou de plusieurs investisseurs afin de leur fournir des services de gestion d'investissement.
- Déclarent à leurs investisseurs qu'ils ont pour objet d'investir les fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-value en capital et/ou de revenus d'investissement.
- Évaluent et apprécient la performance de la quasi-totalité de leurs investissements sur la base de la juste valeur.

Le jugement le plus important posé par la direction pour déterminer que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement est que la quasi-totalité de leurs placements sont évalués et appréciés à la juste valeur.

Pour classer et évaluer les instruments financiers détenus par les Fonds, la direction est tenue de poser des jugements importants aux termes d'IFRS 9 « Instruments financiers ». La direction a procédé à l'évaluation du modèle économique des Fonds qui veut que la quasi-totalité des actifs et passifs financiers est détenue afin d'être transigée. La direction a établi que la comptabilisation à la juste valeur par le biais du résultat net correspond à la présentation et l'évaluation la plus adéquate pour ces actifs et passifs financiers.

Devises étrangères

Les états financiers des Fonds sont présentés en dollars canadiens, ce qui correspond à la devise fonctionnelle des Fonds.

Certains placements et autres éléments d'actif et de passif sont libellés en devises. Ceux-ci sont convertis dans la devise fonctionnelle au taux de change en vigueur à chaque date d'évaluation incluant à la date de clôture de la période. Les achats et les ventes de placements ainsi que les produits et les charges sont convertis au taux de change en vigueur aux dates respectives des transactions. Les gains ou les pertes de change réalisés et non réalisés sont comptabilisés dans l'état du résultat global, respectivement dans les postes « Gain net (perte nette) réalisé(e) à la cession des placements » et « Gain net (perte nette) non réalisé(e) sur les placements ». Les écarts de conversion se rapportant à la trésorerie sont présentés sous le poste « Écart de conversion sur la trésorerie ».

Instruments financiers – Classement et comptabilisation

Lors de la comptabilisation initiale des instruments financiers, les Fonds comptabilisent ceux-ci à la juste valeur, majorée des coûts de transactions dans le cas des instruments financiers évalués au coût amorti. L'évaluation ultérieure des instruments financiers dépend de leur classement. Les Fonds classent les actifs financiers dans l'une des catégories suivantes : à la juste valeur par le biais du résultat net ou au coût amorti. Les Fonds classent les passifs financiers dans l'une des catégories suivantes : à la juste valeur par le biais du résultat net ou au coût amorti.

Les instruments financiers sont classés en fonction de la nature et de l'utilisation par les Fonds de l'instrument financier au moment de sa comptabilisation initiale.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES (suite)

Placements

Les placements incluent des actions, des titres négociés en Bourse, des obligations, des fonds de placement ainsi que du marché monétaire. Les placements des Fonds sont classés à la juste valeur par le biais du résultat net, puisque l'objectif visé n'est pas la collection de flux de trésorerie contractuels, ni la collection de flux de trésorerie contractuels et la vente.

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de transaction et le coût des placements est établi selon la méthode du coût moyen.

Instruments financiers dérivés

Les instruments financiers dérivés comprennent des contrats de change standardisés. Ces instruments financiers sont évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, étant donné qu'ils sont détenus à des fins de transaction.

La juste valeur d'un contrat à terme représente le prix qui serait reçu pour la vente d'un actif ou payé pour le transfert d'un passif lors d'une transaction normale entre des intervenants du marché à la date d'évaluation. La juste valeur de ces contrats est comptabilisée sous le poste « Juste valeur des instruments financiers dérivés » à l'actif à l'état de la situation financière. Les instruments financiers dérivés ayant une juste valeur négative sont présentés au passif à l'état de la situation financière.

Parts des Fonds détenues par les souscripteurs

Les parts des Fonds détenues par les souscripteurs sont classées comme passifs financiers et évaluées au coût amorti. Étant donné que les parts sont rachetables en tout temps, leur juste valeur correspond à leur valeur comptable, soit leur valeur de rachat.

Trésorerie et découvert bancaire

La trésorerie et le découvert bancaire représentent les comptes bancaires. Ils sont évalués au coût amorti.

Autres éléments d'actif et de passif

Les autres éléments d'actif incluent les cessions de placements à recevoir ainsi que les autres débiteurs alors que les autres éléments de passif incluent les achats de placements à payer ainsi que les autres créiteurs. Ces autres éléments d'actif et de passif sont évalués au coût amorti.

Instruments financiers – Dépréciation d'actifs financiers

Les Fonds doivent comptabiliser une correction de valeur pour pertes au titre des pertes de crédit attendues sur leurs actifs financiers évalués au coût amorti. Les Fonds ont déterminé que les montants ne sont pas significatifs, donc aucune perte de crédit n'a été comptabilisée au cours de la période.

Prêts de titres

Certains Fonds peuvent recourir aux prêts de titres dans le but de gagner des revenus additionnels. Certains titres sont prêtés à d'autres établissements pour une courte période. Les Fonds reçoivent des garanties, qui représentent au minimum 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Ces garanties sont déposées par l'emprunteur auprès d'un dépositaire de titres et y sont conservées jusqu'à ce que les titres prêtés aient été remis aux Fonds. Les garanties des titres prêtés sont constituées, de bons du Trésor, d'obligations du Canada ou d'une province canadienne. Afin d'assurer que la juste valeur des titres donnés en garantie est supérieure à 102 %, la juste valeur des titres prêtés fait l'objet d'un suivi quotidien. Les titres prêtés continuent d'être présentés dans le tableau des titres en portefeuille ainsi que dans l'état de la situation financière du Fonds.

Les revenus provenant de prêts de titres sont présentés sous le poste « Prêts de titres » à l'état du résultat global. La valeur des titres prêtés et de la garantie reçue par les Fonds effectuant des opérations de prêts de titres est présentée dans les notes spécifiques de chacun de ces Fonds.

Comptabilisation des revenus

Les revenus de placements sont comptabilisés sur base d'exercice.

Les gains et les pertes réalisés à la cession de placements ainsi que les gains et les pertes non réalisés sur les placements sont calculés en fonction du coût moyen des placements et, le cas échéant, excluent les frais de transactions imputés aux résultats dès qu'ils sont encourus.

Les intérêts aux fins de l'attribution constituent les montants d'intérêt nominal reçus par les Fonds. Les Fonds n'amortissent pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe.

Les revenus de dividendes sont comptabilisés à compter de la date ex-dividende.

Les revenus de distribution et les gains nets distribués par le fonds sous-jacent sont comptabilisés au moment de la distribution par le fonds sous-jacent et sont basés sur l'allocation établie par le gestionnaire de ce fonds. Les revenus de distribution par le fonds sous-jacent peuvent inclure des intérêts et des dividendes.

Les gains ou les pertes réalisés à la liquidation des instruments financiers dérivés sont inclus au poste « Gain net (perte nette) réalisé(e) sur les instruments financiers dérivés » à l'état du résultat global. Les gains et les pertes non réalisés sur les instruments financiers dérivés sont inclus au poste « Gain net (perte nette) non réalisé(e) sur les instruments financiers dérivés ».

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES (suite)

Impôts

Les Fonds peuvent être assujettis à des retenues d'impôt à la source sur les revenus de placement dans certains pays. Ces retenues d'impôt sont présentées distinctement à l'état du résultat global. Les Fonds sont considérés comme des fiducies de fonds distincts en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et de la *Loi sur les impôts* (Québec). De ce fait, les revenus de placements nets des Fonds ainsi que les gains et les pertes réalisés, s'il y a lieu, sont attribués aux souscripteurs de parts à la fin de l'année. Par conséquent, les Fonds ne sont assujettis à aucun impôt sur le revenu à l'exception de tout impôt étranger exigible.

Juste valeur des instruments financiers

L'existence de cotations publiées sur un marché actif constitue la meilleure indication de la juste valeur. La juste valeur des actions des titres négociés en Bourse et des dérivés cotés en Bourse est basée sur leur cours de clôture à la date de présentation de l'information financière lorsque ce cours se situe dans l'écart acheteur - vendeur. Si le cours de clôture ne se situe pas dans l'écart acheteur - vendeur, les Fonds déterminent le point de l'écart acheteur - vendeur le plus représentatif de la juste valeur. Si le marché d'un titre n'est pas actif, la juste valeur est établie par une technique d'évaluation faisant le plus possible appel aux données observées sur les marchés.

Les placements dans les fonds sous-jacents sont évalués à la valeur liquidative par part établie par le gestionnaire du fonds sous-jacent au jour d'évaluation.

La valeur comptable de la trésorerie et découvert bancaire ainsi que des autres éléments d'actif et de passif représente leur juste valeur en raison de leurs caractéristiques ou de leur échéance à court terme.

Les instruments financiers comptabilisés à la juste valeur à l'état de la situation financière sont classés selon une hiérarchie qui reflète l'importance des données utilisées pour établir les évaluations et comprend trois niveaux :

- Niveau 1 - Les prix (non rajustés) cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou passifs identiques;
- Niveau 2 - Évaluation à partir de données observables sur le marché pour l'actif ou le passif, obtenues directement ou indirectement;
- Niveau 3 - Évaluation à partir de données autres que les données observables sur le marché pour l'actif ou le passif.

Un instrument financier est classé au niveau le plus bas de la hiérarchie pour lequel une donnée importante a été prise en compte dans l'évaluation de la juste valeur. Un changement dans la méthode d'évaluation de la juste valeur peut résulter d'un transfert entre niveaux. La méthodologie utilisée dans la classification des instruments financiers n'est pas une indication du niveau de risque associé au placement.

Entités structurées non consolidées

Les Fonds se sont engagés auprès d'entités structurées non consolidées, par le biais de leurs unités de fonds d'obligations et d'actions, qui sont établies aux fins de générer un rendement de placements. Bien qu'ils aient droit à une partie importante des rendements en raison des parts qu'ils détiennent, ces parts ne leur confèrent pas le pouvoir sur les activités pertinentes de ces entités. Ainsi, le contrôle de l'entité n'est pas établi en fonction des droits de vote. L'exposition maximale au risque de perte attribuable aux intérêts des Fonds se limite à la valeur de l'investissement dans ces entités structurées non consolidées.

Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part

L'augmentation (la diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs de chaque classe d'un Fonds par la moyenne pondérée des parts en circulation au cours de la période.

3. MODIFICATIONS DE MÉTHODES COMPTABLES

Nouvelles normes comptables futures

Présentation des états financiers

En janvier 2020, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 1 « Présentation des états financiers ». L'amendement vient préciser le critère concernant le droit de différer le règlement d'un passif pour au moins douze mois après la fin d'exercice, à prendre en compte lors du classement des passifs en tant que passifs courants ou non courants dans l'état de la situation financière. Les dispositions de cet amendement s'appliqueront rétrospectivement aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2022. Une application anticipée est autorisée. En juillet 2020, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 1 « Présentation des états financiers » reportant la date d'application de cet amendement aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2023. Une évaluation de l'incidence de cet amendement sur les états financiers des Fonds est actuellement en cours.

Présentation des états financiers

En février 2021, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 1 « Présentation des états financiers ». L'amendement vient préciser les informations à fournir sur les méthodes comptables en exigeant que les entités fournissent les informations significatives sur les méthodes comptables plutôt que sur les principales méthodes comptables. Les dispositions de cet amendement s'appliqueront de manière prospective aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2023. Une application anticipée est autorisée. Une évaluation de l'incidence de cet amendement sur les états financiers des Fonds est actuellement en cours.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

3. MODIFICATIONS DE MÉTHODES COMPTABLES (suite)

Nouvelles normes comptables futures (suite)

Méthodes comptables, changements d'estimations comptables et erreurs

En février 2021, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 8 « Méthodes comptables, changements d'estimations comptables et erreurs ». L'amendement introduit une définition des estimations comptables et clarifie la distinction entre un changement d'estimation comptable et un changement de méthode comptable. Les dispositions de cet amendement s'appliqueront de manière prospective aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2023. Une application anticipée est autorisée. Une évaluation de l'incidence de cet amendement sur les états financiers des Fonds est actuellement en cours.

4. ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

L'actif net détenu pour le compte des souscripteurs de chaque Fonds se divise en parts d'égale valeur et représente l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs. Les parts des Fonds sont sans valeur nominale et peuvent être émises en nombre illimité. Le prix des parts de chaque classe d'un Fonds correspond à sa valeur liquidative par part avant prise en compte des opérations des souscripteurs de parts et des paiements du jour. Le prix des parts est obtenu en divisant la valeur liquidative de chaque classe du Fonds par le nombre de parts en circulation, les opérations sont ensuite prises en compte d'après le prix des parts de la journée. Le prix des parts est calculé à chaque jour d'évaluation, au bureau de la Société qui administre les Fonds, selon les valeurs de fin de journée.

5. PARTS DES FONDS

Le tableau suivant présente le mouvement des parts des Fonds pour les périodes terminées les 30 juin 2022 et 2021 :

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Marché monétaire Fiera Capital				
Classe A				
2022	110 127	66 534	(27 295)	149 366
2021	149 869	44 975	(87 654)	107 190
Classe B				
2022	71 775	4 935	(13 470)	63 240
2021	60 270	3 812	(10 727)	53 355
Classe C				
2022	35	-	(35)	-
2021	35	-	-	35
Classe E				
2022	631 615	1 789 697	(525 482)	1 895 830
2021	981 373	189 118	(625 364)	545 127
Classe F				
2022	235 985	354 893	(120 816)	470 062
2021	270 226	13 764	(95 804)	188 186
Classe G				
2022	86 207	78 243	(43 651)	120 799
2021	63 720	82 424	(61 438)	84 706
Classe I				
2022	48 402	266 175	(39 961)	274 616
2021	38 481	24	(5 258)	33 247
Classe J				
2022	82 204	297 649	(78 802)	301 051
2021	337 665	2 920 408	(373 186)	2 884 887
Classe N				
2022	130 890	57 840	(43 319)	145 411
2021	142 284	20 517	(78 383)	84 418
Obligations court terme Fiera Capital				
Classe A				
2022	72 583	5 776	(14 782)	63 577
2021	93 058	18 337	(31 456)	79 939

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDOS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations court terme Fiera Capital (suite)				
Classe B				
2022	44 967	4 442	(6 786)	42 623
2021	58 750	2 220	(10 663)	50 307
Classe C				
2022	1 622	45	-	1 667
2021	1 538	42	-	1 580
Classe E				
2022	742 328	568 109	(508 001)	802 436
2021	1 088 355	1 458 351	(1 555 186)	991 520
Classe F				
2022	142 432	29 705	(57 684)	114 453
2021	192 327	62 735	(93 469)	161 593
Classe G				
2022	45 308	5 548	(13 730)	37 126
2021	43 444	10 642	(8 116)	45 970
Classe I				
2022	144 334	176 126	(204 767)	115 693
2021	133 795	103 462	(114 691)	122 566
Classe J				
2022	392 746	732 959	(108 303)	1 017 402
2021	1 264 226	942 062	(1 182 417)	1 023 871
Classe K				
2022	3 150 808	190 086	(457 061)	2 883 833
2021	2 951 807	143 654	(50 449)	3 045 012
Classe N				
2022	41 943	50 837	(48 423)	44 357
2021	47 466	18 870	(24 245)	42 091
Obligations Fiera Capital				
Classe A				
2022	428 095	37 681	(82 052)	383 724
2021	552 866	35 531	(126 094)	462 303
Classe B				
2022	260 475	25 683	(51 741)	234 417
2021	351 256	33 331	(83 107)	301 480
Classe C				
2022	319 961	2 858	(98 911)	223 908
2021	357 948	129	(18 084)	339 993
Classe D				
2022	44 179	-	(31 471)	12 708
2021	67 794	10 437	(21 052)	57 179
Classe E				
2022	1 964 552	258 097	(485 874)	1 736 775
2021	2 659 721	648 791	(1 050 721)	2 257 791
Classe F				
2022	445 031	12 839	(92 860)	365 010
2021	465 710	133 911	(94 964)	504 657

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations Fiera Capital (suite)				
Classe G				
2022	188 509	33 343	(37 073)	184 779
2021	221 633	19 857	(41 943)	199 547
Classe H				
2022	127 742	7 948	(21 338)	114 352
2021	159 790	6 121	(34 915)	130 996
Classe I				
2022	95 591	14 548	(33 979)	76 160
2021	304 690	53 154	(228 701)	129 143
Classe J				
2022	7 816 789	1 745 022	(2 973 096)	6 588 715
2021	10 740 696	1 764 016	(1 875 777)	10 628 935
Classe K				
2022	9 806 182	1 211 652	(981 127)	10 036 707
2021	8 862 959	869 629	(76 312)	9 656 276
Classe N				
2022	638 787	100 113	(323 729)	415 171
2021	485 091	161 390	(80 853)	565 628
Obligations PIMCO				
Classe A				
2022	174 101	25 238	(54 670)	144 669
2021	212 436	26 617	(41 577)	197 476
Classe B				
2022	113 845	9 884	(31 535)	92 194
2021	155 230	15 960	(34 402)	136 788
Classe C				
2022	403 979	5 242	(29 504)	379 717
2021	485 445	4 622	(28 449)	461 618
Classe E				
2022	1 973 337	307 372	(398 717)	1 881 992
2021	2 131 020	346 478	(609 622)	1 867 876
Classe F				
2022	287 567	15 714	(45 265)	258 016
2021	369 230	110 483	(48 555)	431 158
Classe G				
2022	134 093	2 357	(27 616)	108 834
2021	183 224	33 217	(69 896)	146 545
Classe I				
2022	232 588	30 000	(79 323)	183 265
2021	252 440	34 860	(105 682)	181 618
Classe J				
2022	4 712 076	1 307 081	(1 563 841)	4 455 316
2021	5 402 407	1 445 133	(1 010 435)	5 837 105
Classe L				
2022	16 505	3 329	-	19 834
2021	27 535	6 401	(6 836)	27 100

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations PIMCO (suite)				
Classe N				
2022	129 210	21 971	(26 400)	124 781
2021	115 778	32 464	(25 596)	122 646
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe				
Classe A				
2022	9 193	3 206	(2 039)	10 360
2021	9 721	888	(448)	10 161
Classe B				
2022	2 823	350	(304)	2 869
2021	9 163	356	(1 063)	8 456
Classe E				
2022	277 813	51 079	(84 259)	244 633
2021	411 826	685 599	(112 385)	985 040
Classe F				
2022	50 990	53 839	(23 047)	81 782
2021	79 892	2 720	(11 988)	70 624
Classe G				
2022	18 684	-	(6 526)	12 158
2021	18 266	911	(889)	18 288
Classe I				
2022	186 817	19 168	(100 704)	105 281
2021	451 304	258 855	(42 967)	667 192
Classe J				
2022	8 173 749	1 395 591	(2 881 813)	6 687 527
2021	6 111 175	1 526 907	(177 437)	7 460 645
Classe N				
2022	540 808	449 537	(89 368)	900 977
2021	375 981	117 088	(13 764)	479 305
Obligations mondiales PIMCO				
Classe A				
2022	44 645	3 057	(14 095)	33 607
2021	64 404	13 577	(23 475)	54 506
Classe B				
2022	34 313	2 111	(5 012)	31 412
2021	42 658	4 117	(7 718)	39 057
Classe C				
2022	39 048	1 324	(3 109)	37 263
2021	35 359	8 101	(1 738)	41 722
Classe E				
2022	806 580	131 458	(139 660)	798 378
2021	867 888	163 954	(164 006)	867 836
Classe F				
2022	205 570	28 235	(21 954)	211 851
2021	216 316	16 549	(24 384)	208 481
Classe G				
2022	146 420	3 066	(32 138)	117 348
2021	165 300	15 567	(32 045)	148 822

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations mondiales PIMCO (suite)				
Classe I				
2022	254 433	46 272	(155 134)	145 571
2021	528 666	150 310	(73 862)	605 114
Classe J				
2022	2 504 572	360 313	(626 684)	2 238 201
2021	3 127 935	292 383	(558 990)	2 861 328
Classe L				
2022	124 738	8 152	(2 897)	129 993
2021	8 092	3 154	-	11 246
Classe N				
2022	239 132	53 041	(165 794)	126 379
2021	200 472	50 774	(22 027)	229 219
Obligations de sociétés CI				
Classe A				
2022	39 862	10 010	(5 760)	44 112
2021	40 015	18 513	(21 613)	36 915
Classe B				
2022	27 285	6 805	(4 599)	29 491
2021	28 399	5 403	(4 784)	29 018
Classe E				
2022	1 378 356	311 018	(321 238)	1 368 136
2021	1 266 150	461 702	(444 631)	1 283 221
Classe F				
2022	341 550	75 473	(60 157)	356 866
2021	291 964	39 336	(24 038)	307 262
Classe G				
2022	183 222	37 426	(33 296)	187 352
2021	126 266	19 377	(27 971)	117 672
Classe I				
2022	572 905	167 046	(78 365)	661 586
2021	166 749	31 183	(27 103)	170 829
Classe J				
2022	374 161	50 501	(339 440)	85 222
2021	293 003	88 343	(52 720)	328 626
Classe N				
2022	57 355	63 068	(6 269)	114 154
2021	39 015	24 699	(11 964)	51 750
Indice obligataire BlackRock				
Classe A				
2022	20 765	2 852	(3 227)	20 390
2021	33 687	1 725	(2 280)	33 132
Classe B				
2022	9 821	558	(952)	9 427
2021	12 259	4 203	(6 089)	10 373
Classe C				
2022	13 862	561	(722)	13 701
2021	14 673	(1)	(665)	14 007

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDOS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice obligataire BlackRock (suite)				
Classe E				
2022	150 552	17 314	(34 687)	133 179
2021	264 370	82 090	(101 230)	245 230
Classe F				
2022	96 705	5 031	(22 002)	79 734
2021	57 348	59 457	(17 927)	98 878
Classe G				
2022	34 482	46	(2 191)	32 337
2021	11 423	23 452	(1 736)	33 139
Classe I				
2022	15 295	21 147	(374)	36 068
2021	29 382	511	(13 919)	15 974
Classe J				
2022	4 423 836	863 943	(2 271 905)	3 015 874
2021	1 423 352	216 297	(208 700)	1 430 949
Classe N				
2022	35 527	620	(2 120)	34 027
2021	35 918	487	(438)	35 967
Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire				
Classe A				
2022	172 687	28 531	(38 690)	162 528
2021	233 624	32 868	(55 475)	211 017
Classe B				
2022	67 361	14 364	(16 720)	65 005
2021	80 982	3 583	(13 738)	70 827
Classe C				
2022	318 330	492	(14 453)	304 369
2021	347 377	-	(17 949)	329 428
Classe E				
2022	743 608	187 923	(107 153)	824 378
2021	861 271	132 876	(155 364)	838 783
Classe F				
2022	341 199	69 029	(37 184)	373 044
2021	484 617	41 897	(181 753)	344 761
Classe G				
2022	172 523	1 923	(21 778)	152 668
2021	287 729	11 103	(54 459)	244 373
Classe I				
2022	139 832	1 326	(3 592)	137 566
2021	125 004	4 252	(4 579)	124 677
Classe J				
2022	121	-	-	121
2021	121	-	-	121
Classe N				
2022	12 407	317	(1)	12 723
2021	17 748	65	(1)	17 812

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré				
Classe A				
2022	221 408	7 733	(21 242)	207 899
2021	274 253	23 863	(56 613)	241 503
Classe B				
2022	133 981	11 835	(17 014)	128 802
2021	158 391	35 126	(55 657)	137 860
Classe C				
2022	561 992	3 253	(33 012)	532 233
2021	659 183	3 640	(64 818)	598 005
Classe E				
2022	913 353	61 303	(107 741)	866 915
2021	1 443 764	110 116	(621 188)	932 692
Classe F				
2022	661 284	92 200	(151 433)	602 051
2021	910 374	49 578	(264 165)	695 787
Classe G				
2022	287 145	6 583	(42 576)	251 152
2021	352 795	12 923	(49 345)	316 373
Classe I				
2022	76 360	73 727	(29 117)	120 970
2021	49 571	3 355	(2 609)	50 317
Classe J				
2022	125	-	-	125
2021	125	-	-	125
Classe N				
2022	7 947	4 200	(839)	11 308
2021	14 720	545	(2 849)	12 416
Portefeuille bêta intelligent plus - croissance				
Classe A				
2022	120 807	2 250	(8 711)	114 346
2021	182 318	12 699	(71 855)	123 162
Classe B				
2022	15 016	129	(186)	14 959
2021	17 896	131	(712)	17 315
Classe C				
2022	288 333	1 588	(21 006)	268 915
2021	365 912	5 674	(70 120)	301 466
Classe E				
2022	288 426	12 966	(31 923)	269 469
2021	358 192	34 223	(93 845)	298 570
Classe F				
2022	215 263	7 900	(41 272)	181 891
2021	318 410	17 235	(109 826)	225 819
Classe G				
2022	88 198	3 471	(10 612)	81 057
2021	124 160	4 860	(30 609)	98 411

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FOND (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Portefeuille bêta intelligent plus – croissance (suite)				
Classe I				
2022	111	16 446	(122)	16 435
2021	6 048	-	(5 937)	111
Classe J				
2022	127	-	-	127
2021	127	-	-	127
Classe N				
2022	3 379	3 419	(804)	5 994
2021	1 889	1 745	(321)	3 313
Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux				
Classe A				
2022	25 859	2 398	(2 579)	25 678
2021	30 690	607	(3 490)	27 807
Classe B				
2022	65 622	3 190	(17 738)	51 074
2021	96 810	2 771	(27 791)	71 790
Classe C				
2022	321 237	6 348	(33 420)	294 165
2021	540 777	2 317	(200 085)	343 009
Classe E				
2022	148 218	17 734	(8 559)	157 393
2021	185 320	20 229	(41 276)	164 273
Classe F				
2022	98 855	9 337	(9 211)	98 981
2021	117 191	15 230	(29 890)	102 531
Classe G				
2022	23 211	367	(1 494)	22 084
2021	32 119	1 540	(10 356)	23 303
Classe I				
2022	20 455	2 562	(253)	22 764
2021	20 851	926	(1 921)	19 856
Classe J				
2022	128	-	-	128
2021	128	-	-	128
Classe N				
2022	3 304	1 626	(490)	4 440
2021	3 936	339	(755)	3 520
Stratégie sécuritaire				
Classe A				
2022	725 997	99 817	(161 224)	664 590
2021	831 431	114 317	(173 835)	771 913
Classe B				
2022	522 078	65 178	(80 168)	507 088
2021	578 840	79 030	(110 064)	547 806
Classe C				
2022	425 782	2 403	(32 106)	396 079
2021	485 611	6 535	(35 419)	456 727

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie sécuritaire (suite)				
Classe E				
2022	4 804 128	641 960	(2 014 241)	3 431 847
2021	3 914 445	946 293	(733 073)	4 127 665
Classe F				
2022	1 130 326	133 863	(166 169)	1 098 020
2021	1 052 891	243 335	(158 047)	1 138 179
Classe G				
2022	981 701	41 971	(105 273)	918 399
2021	1 082 557	59 278	(148 372)	993 463
Classe I				
2022	446 573	86 725	(304 358)	228 940
2021	100 702	155 812	(59 906)	196 608
Classe J				
2022	84	-	-	84
2021	84	-	-	84
Classe L				
2022	312 981	7 739	(11 683)	309 037
2021	353 715	3 674	(13 654)	343 735
Classe N				
2022	219 257	2 004	(109 667)	111 594
2021	217 790	13 696	(9 040)	222 446
Stratégie équilibrée				
Classe A				
2022	1 587 797	130 473	(225 864)	1 492 406
2021	1 727 595	160 969	(229 097)	1 659 467
Classe B				
2022	996 166	60 836	(105 886)	951 116
2021	1 171 061	127 210	(223 892)	1 074 379
Classe C				
2022	1 353 440	29 222	(105 853)	1 276 809
2021	1 526 004	68 334	(179 820)	1 414 518
Classe E				
2022	5 185 491	839 873	(663 110)	5 362 254
2021	4 731 718	1 234 942	(856 098)	5 110 562
Classe F				
2022	1 762 906	206 716	(236 195)	1 733 427
2021	1 466 322	401 303	(159 937)	1 707 688
Classe G				
2022	1 006 905	86 060	(98 748)	994 217
2021	1 154 768	78 825	(156 543)	1 077 050
Classe I				
2022	272 121	13 283	(13 035)	272 369
2021	227 119	39 157	(12 002)	254 274
Classe J				
2022	422 962	30 552	(103 669)	349 845
2021	1 409 823	81 525	(70 224)	1 421 124

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie équilibrée (suite)				
Classe L				
2022	1 485 862	135 978	-	1 621 840
2021	1 340 204	82 362	-	1 422 566
Classe N				
2022	886 939	34 668	(39 601)	882 006
2021	797 090	33 795	(29 326)	801 559
Stratégie croissance				
Classe A				
2022	410 171	22 300	(32 028)	400 443
2021	485 660	46 538	(83 511)	448 687
Classe B				
2022	160 422	8 161	(17 011)	151 572
2021	193 176	13 592	(29 969)	176 799
Classe C				
2022	462 733	6 079	(38 907)	429 905
2021	488 258	23 423	(35 686)	475 995
Classe E				
2022	1 335 323	175 908	(137 538)	1 373 693
2021	1 241 221	225 586	(127 323)	1 339 484
Classe F				
2022	482 505	54 764	(91 729)	445 540
2021	476 681	110 161	(84 037)	502 805
Classe G				
2022	150 806	21 568	(21 492)	150 882
2021	189 197	21 788	(17 224)	193 761
Classe I				
2022	47 465	3 231	(10 549)	40 147
2021	30 279	6 242	(7 691)	28 830
Classe J				
2022	74	-	-	74
2021	74	-	-	74
Classe L				
2022	941 348	80 304	(7 313)	1 014 339
2021	979 951	46 048	(5 901)	1 020 098
Classe N				
2022	221 293	30 108	(19 256)	232 145
2021	217 067	11 092	(8 519)	219 640
Stratégie audacieuse				
Classe A				
2022	84 417	6 831	(6 053)	85 195
2021	88 224	10 169	(15 676)	82 717
Classe B				
2022	31 536	2 291	(3 114)	30 713
2021	33 798	5 491	(7 661)	31 628
Classe C				
2022	941 158	23 125	(60 513)	903 770
2021	968 140	30 138	(43 067)	955 211

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie audacieuse (suite)				
Classe E				
2022	580 222	53 933	(44 369)	589 786
2021	589 564	99 463	(126 426)	562 601
Classe F				
2022	162 100	13 518	(19 085)	156 533
2021	145 117	31 188	(25 177)	151 128
Classe G				
2022	74 592	10 364	(4 560)	80 396
2021	88 191	4 328	(21 897)	70 622
Classe I				
2022	5 462	548	(90)	5 920
2021	875	4 682	(10)	5 547
Classe J				
2022	78	-	-	78
2021	78	-	-	78
Classe L				
2022	409 796	15 369	(3 378)	421 787
2021	394 884	10 335	(17 095)	388 124
Classe N				
2022	36 417	3 717	(2 930)	37 204
2021	62 936	3 902	(33 386)	33 452
Stratégie 100% actions				
Classe A				
2022	499	(1)	(1)	497
2021	-	500	-	500
Classe B				
2022	495	-	(4)	491
2021	-	500	-	500
Classe E				
2022	1 826	31 282	(125)	32 983
2021	-	500	-	500
Classe F				
2022	498	237	(3)	732
2021	-	500	-	500
Classe G				
2022	496	-	(4)	492
2021	-	500	-	500
Classe I				
2022	100	-	-	100
2021	-	100	-	100
Classe J				
2022	100	-	-	100
2021	-	100	-	100
Classe L				
2022	100	-	-	100
2021	-	100	-	100

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie 100% actions (suite)				
Classe N				
2022	507	13	-	520
2021	-	500	-	500
Celestia sécuritaire				
Classe A				
2022	275 691	51 572	(97 886)	229 377
2021	373 170	37 170	(81 943)	328 397
Classe B				
2022	135 679	24 535	(27 721)	132 493
2021	157 753	14 969	(27 414)	145 308
Classe C				
2022	353 785	1 914	(19 880)	335 819
2021	449 708	2 856	(48 130)	404 434
Classe E				
2022	2 623 171	1 539 167	(475 070)	3 687 268
2021	2 917 819	242 924	(462 732)	2 698 011
Classe F				
2022	1 165 213	217 118	(175 140)	1 207 191
2021	1 213 614	86 227	(140 208)	1 159 633
Classe G				
2022	417 382	33 889	(46 209)	405 062
2021	489 150	16 354	(48 228)	457 276
Classe I				
2022	29 223	291 060	(33 498)	286 785
2021	13 095	1 632	(301)	14 426
Classe J				
2022	84	-	-	84
2021	84	-	-	84
Classe N				
2022	171 090	141 590	(14 430)	298 250
2021	176 336	21 131	(21 015)	176 452
Celestia équilibré				
Classe A				
2022	559 447	70 517	(120 696)	509 268
2021	685 758	41 201	(104 782)	622 177
Classe B				
2022	234 788	42 651	(50 382)	227 057
2021	298 597	22 041	(54 208)	266 430
Classe C				
2022	899 511	13 903	(64 316)	849 098
2021	1 041 144	36 484	(124 705)	952 923
Classe E				
2022	3 027 683	418 810	(466 509)	2 979 984
2021	3 363 047	233 600	(613 542)	2 983 105
Classe F				
2022	1 141 724	98 225	(129 841)	1 110 108
2021	1 220 222	110 817	(258 270)	1 072 769

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Celestia équilibré (suite)				
Classe G				
2022	482 911	37 553	(55 575)	464 889
2021	563 535	41 486	(102 888)	502 133
Classe I				
2022	146 111	123 648	(11 041)	258 718
2021	118 392	15 177	(12 723)	120 846
Classe J				
2022	82	-	-	82
2021	82	-	-	82
Classe N				
2022	588 248	31 379	(33 327)	586 300
2021	610 102	24 703	(40 161)	594 644
Celestia croissance				
Classe A				
2022	129 910	15 675	(19 997)	125 588
2021	154 139	7 849	(26 953)	135 035
Classe B				
2022	64 924	11 161	(11 600)	64 485
2021	75 291	9 545	(14 352)	70 484
Classe C				
2022	563 603	5 835	(45 246)	524 192
2021	668 613	19 333	(103 771)	584 175
Classe E				
2022	1 136 259	350 648	(279 629)	1 207 278
2021	1 128 938	128 356	(160 361)	1 096 933
Classe F				
2022	349 640	89 221	(42 312)	396 549
2021	294 006	31 779	(58 917)	266 868
Classe G				
2022	256 426	18 909	(42 929)	232 406
2021	269 414	30 947	(59 778)	240 583
Classe I				
2022	20 990	62 731	(984)	82 737
2021	18 332	9 656	(3 900)	24 088
Classe J				
2022	79	-	-	79
2021	79	-	-	79
Classe N				
2022	181 908	14 990	(4 561)	192 337
2021	176 063	10 382	(7 684)	178 761
Celestia audacieux				
Classe A				
2022	51 661	4 464	(5 538)	50 587
2021	73 545	2 009	(8 719)	66 835
Classe B				
2022	27 417	2 059	(6 955)	22 521
2021	36 799	1 194	(8 865)	29 128

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Celestia audacieux (suite)				
Classe C				
2022	755 398	26 807	(53 135)	729 070
2021	831 081	5 523	(57 232)	779 372
Classe D				
2022	43 355	-	(28 111)	15 244
2021	88 566	910	(25 530)	63 946
Classe E				
2022	337 945	25 323	(46 472)	316 796
2021	360 559	23 447	(55 405)	328 601
Classe F				
2022	140 149	13 969	(17 219)	136 899
2021	152 014	17 750	(40 914)	128 850
Classe G				
2022	102 451	30 378	(26 195)	106 634
2021	96 289	40 727	(28 685)	108 331
Classe H				
2022	288 686	16 471	(14 295)	290 862
2021	372 416	15 579	(93 225)	294 770
Classe I				
2022	67 783	1 119	(1 836)	67 066
2021	79 763	9 350	(20 913)	68 200
Classe J				
2022	79	-	-	79
2021	79	-	-	79
Classe N				
2022	36 282	4 523	(1 003)	39 802
2021	33 455	2 851	(774)	35 532
Célestia 100% actions				
Classe A				
2022	499	5 129	(5)	5 623
2021	-	500	-	500
Classe B				
2022	495	-	(4)	491
2021	-	500	-	500
Classe E				
2022	24 291	31 234	(2 220)	53 305
2021	-	703	-	703
Classe F				
2022	498	258	(2)	754
2021	-	500	-	500
Classe G				
2022	496	-	(4)	492
2021	-	500	-	500
Classe I				
2022	100	-	-	100
2021	-	100	-	100

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Céléstia 100% actions (suite)				
Classe J				
2022	100	-	-	100
2021	-	100	-	100
Classe N				
2022	500	2 608	(870)	2 238
2021	-	500	-	500
Revenu sécuritaire Guardian				
Classe A				
2022	36 549	8 062	(8 040)	36 571
2021	54 741	2 065	(16 917)	39 889
Classe B				
2022	20 233	1 304	(4 426)	17 111
2021	46 941	901	(27 276)	20 566
Classe C				
2022	21 295	1	(1 104)	20 192
2021	22 790	-	(1 120)	21 670
Classe E				
2022	1 296 206	221 761	(321 379)	1 196 588
2021	1 468 657	254 064	(304 950)	1 417 771
Classe F				
2022	559 430	56 637	(114 657)	501 410
2021	562 428	59 153	(60 459)	561 122
Classe G				
2022	189 196	18 648	(8 401)	199 443
2021	186 058	8 686	(19 282)	175 462
Classe I				
2022	40 578	57 065	(29 676)	67 967
2021	33 011	2 676	(466)	35 221
Classe J				
2022	102	-	-	102
2021	102	-	-	102
Classe L				
2022	34 401	-	-	34 401
2021	36 144	-	-	36 144
Classe N				
2022	58 700	132	(5 263)	53 569
2021	69 318	310	(4 974)	64 654
Revenu Guardian				
Classe A				
2022	40 789	10 786	(11 132)	40 443
2021	46 082	995	(6 654)	40 423
Classe B				
2022	24 313	3 057	(4 049)	23 321
2021	23 237	1 490	(437)	24 290
Classe C				
2022	62 989	1 751	(14 250)	50 490
2021	79 704	-	(7 882)	71 822

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Revenu Guardian (suite)				
Classe E				
2022	1 251 856	293 196	(358 292)	1 186 760
2021	1 523 148	374 567	(521 686)	1 376 029
Classe F				
2022	856 119	57 972	(67 715)	846 376
2021	962 341	45 764	(90 178)	917 927
Classe G				
2022	292 070	31 189	(35 804)	287 455
2021	298 774	9 448	(11 022)	297 200
Classe I				
2022	82 378	444	(3 083)	79 739
2021	78 710	9 214	(4 501)	83 423
Classe J				
2022	102	-	-	102
2021	102	-	-	102
Classe L				
2022	34 667	-	-	34 667
2021	35 421	-	-	35 421
Classe N				
2022	53 675	15 566	(10 048)	59 193
2021	68 141	35 898	(50 376)	53 663
Répartition d'actifs canadiens CI				
Classe A				
2022	1 360 988	64 450	(148 433)	1 277 005
2021	1 576 596	114 748	(253 710)	1 437 634
Classe B				
2022	820 644	35 781	(109 936)	746 489
2021	1 003 126	100 741	(192 220)	911 647
Classe C				
2022	1 562 638	27 970	(137 574)	1 453 034
2021	1 762 784	26 838	(136 257)	1 653 365
Classe E				
2022	2 826 422	218 498	(331 141)	2 713 779
2021	3 106 119	243 213	(439 482)	2 909 850
Classe F				
2022	996 211	56 497	(115 633)	937 075
2021	1 215 152	96 401	(265 715)	1 045 838
Classe G				
2022	555 052	65 530	(74 587)	545 995
2021	658 123	59 871	(140 377)	577 617
Classe I				
2022	149 540	18 839	(13 073)	155 306
2021	128 237	20 161	(12 751)	135 647
Classe J				
2022	127	-	-	127
2021	127	-	-	127

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Répartition d'actifs canadiens CI (suite)				
Classe L				
2022	260 802	-	(3 498)	257 304
2021	285 285	1 645	(14 798)	272 132
Classe N				
2022	183 554	1 573	(7 933)	177 194
2021	197 492	21 434	(34 720)	184 206
Revenu et croissance mondial CI				
Classe A				
2022	979 380	89 549	(80 305)	988 624
2021	1 059 333	228 742	(257 637)	1 030 438
Classe B				
2022	612 153	20 180	(34 505)	597 828
2021	718 377	35 602	(112 487)	641 492
Classe C				
2022	1 557 954	90 607	(175 866)	1 472 695
2021	1 448 415	308 809	(131 023)	1 626 201
Classe E				
2022	1 2570 621	1 844 719	(2 557 635)	11 857 705
2021	1 1579 055	2 084 840	(1 579 959)	12 083 936
Classe F				
2022	7 554 202	1 249 510	(941 959)	7 861 753
2021	6 864 699	1 466 823	(842 690)	7 488 832
Classe G				
2022	1 613 686	122 842	(154 562)	1 581 966
2021	1 674 731	235 912	(231 617)	1 679 026
Classe I				
2022	708 014	77 410	(76 264)	709 160
2021	595 932	136 141	(78 403)	653 670
Classe J				
2022	152	-	-	152
2021	152	-	-	152
Classe L				
2022	1 162 543	5 843	(18 780)	1 149 606
2021	1 110 129	25 594	(18 739)	1 116 984
Classe N				
2022	212 225	9 450	(29 885)	191 790
2021	239 690	26 397	(42 993)	223 094
Actions canadiennes dividendes Guardian				
Classe A				
2022	173 035	28 198	(34 173)	167 060
2021	229 468	42 268	(71 041)	200 695
Classe B				
2022	157 452	22 773	(23 444)	156 781
2021	233 662	16 736	(64 266)	186 132
Classe E				
2022	988 035	1 552 640	(278 933)	2 261 742
2021	900 624	218 557	(188 670)	930 511

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions canadiennes dividendes Guardian (suite)				
Classe F				
2022	516 538	330 327	(146 274)	700 591
2021	538 605	51 454	(140 289)	449 770
Classe G				
2022	717 572	159 939	(213 777)	663 734
2021	1 203 498	165 253	(504 655)	864 096
Classe I				
2022	51 435	125 532	(41 736)	135 231
2021	50 175	8 302	(8 742)	49 735
Classe J				
2022	987 372	227 287	(904 102)	310 557
2021	1 233 617	29 434	(256 251)	1 006 800
Classe L				
2022	227 772	23 585	-	251 357
2021	152 346	1	(3 327)	149 020
Classe N				
2022	37 726	41 687	(478)	78 935
2021	32 999	5 521	(617)	37 903
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée				
Classe A				
2022	437 063	15 067	(33 294)	418 836
2021	518 954	38 553	(90 458)	467 049
Classe B				
2022	230 496	12 836	(30 459)	212 873
2021	307 088	20 646	(67 521)	260 213
Classe D				
2022	31 266	-	(22 537)	8 729
2021	83 892	-	(33 317)	50 575
Classe E				
2022	817 855	110 831	(93 956)	834 730
2021	652 388	168 780	(87 328)	733 840
Classe F				
2022	265 709	25 044	(32 327)	258 426
2021	263 338	31 539	(38 238)	256 639
Classe G				
2022	176 768	11 839	(19 332)	169 275
2021	200 021	24 365	(40 597)	183 789
Classe H				
2022	173 871	16 840	(14 327)	176 384
2021	180 751	20 255	(24 364)	176 642
Classe I				
2022	299 601	24 599	(26 032)	298 168
2021	275 174	56 574	(45 179)	286 569
Classe J				
2022	4 059 403	263 051	(426 343)	3 896 111
2021	5 528 059	241 013	(632 948)	5 136 124

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée (suite)				
Classe N				
2022	237 641	26 594	(43 861)	220 374
2021	211 246	34 886	(21 087)	225 045
Actions canadiennes Triasima				
Classe A				
2022	246 056	14 611	(23 235)	237 432
2021	272 415	30 198	(46 771)	255 842
Classe B				
2022	194 529	10 078	(18 721)	185 886
2021	232 976	13 009	(39 241)	206 744
Classe D				
2022	11 981	-	(10 293)	1 688
2021	34 358	1	(11 040)	23 319
Classe E				
2022	1 117 590	262 177	(199 587)	1 180 180
2021	870 541	287 944	(130 112)	1 028 373
Classe F				
2022	404 520	82 648	(58 286)	428 882
2021	401 727	60 349	(54 067)	408 009
Classe G				
2022	152 669	14 294	(10 417)	156 546
2021	174 858	8 969	(28 967)	154 860
Classe H				
2022	64 184	5 460	(5 633)	64 011
2021	60 217	15 446	(9 900)	65 763
Classe I				
2022	152 179	48 788	(18 706)	182 261
2021	77 817	44 579	(12 524)	109 872
Classe J				
2022	5 763 916	386 297	(1 171 948)	4 978 265
2021	7 679 599	419 111	(1 057 613)	7 041 097
Classe K				
2022	4 048 735	352 700	(457 189)	3 944 246
	4997			
2021	294	76 542	(851 521)	4 222 315
Classe L				
2022	17 670	4 863	-	22 533
2021	100	5 677	(100)	5 677
Classe N				
2022	179 450	14 783	(9 943)	184 290
2021	178 211	14 427	(12 298)	180 340
Indice canadien BlackRock				
Classe A				
2022	30 696	4 628	(3 162)	32 162
2021	36 179	1 055	(3 074)	34 160
Classe B				
2022	195 112	4 940	(9 857)	190 195
2021	241 953	4 177	(45 057)	201 073

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice canadien BlackRock (suite)				
Classe D				
2022	23 371	-	(14 578)	8 793
2021	60 488	95	(23 549)	37 034
Classe E				
2022	188 772	74 153	(42 635)	220 290
2021	207 335	37 746	(43 900)	201 181
Classe F				
2022	49 693	22 204	(7 854)	64 043
2021	49 667	10 888	(4 691)	55 864
Classe G				
2022	28 270	2 666	(3 643)	27 293
2021	39 316	3 263	(11 060)	31 519
Classe H				
2022	116 378	19 364	(17 300)	118 442
2021	125 043	12 256	(17 983)	119 316
Classe I				
2022	28 758	51 689	(18 698)	61 749
2021	26 750	1 597	(2 139)	26 208
Classe J				
2022	544	82	(1)	625
2021	79 758	117	(79 324)	551
Classe N				
2022	37 281	1 716	(876)	38 121
2021	30 943	2 161	(604)	32 500
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital				
Classe A				
2022	109 510	7 551	(11 938)	105 123
2021	129 739	21 754	(31 488)	120 005
Classe B				
2022	73 348	3 887	(8 673)	68 562
2021	91 553	8 415	(20 103)	79 865
Classe E				
2022	407 655	65 721	(51 600)	421 776
2021	259 510	141 931	(46 078)	355 363
Classe F				
2022	183 731	26 656	(32 726)	177 661
2021	187 603	23 007	(30 736)	179 874
Classe G				
2022	43 772	4 986	(5 605)	43 153
2021	45 710	7 866	(6 032)	47 544
Classe I				
2022	60 102	5 279	(18 956)	46 425
2021	53 820	13 695	(14 362)	53 153
Classe J				
2022	55 691	1 230	(2 579)	54 342
2021	62 570	1 801	(6 358)	58 013

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital (suite)				
Classe N				
2022	39 286	3 851	(2 628)	40 509
2021	35 354	4 444	(2 818)	36 980
Actions américaines Hillsdale				
Classe A				
2022	15 593	1 566	(2 626)	14 533
2021	16 762	2 626	(3 620)	15 768
Classe B				
2022	4 780	1 051	(1 197)	4 634
2021	5 244	1 074	(732)	5 586
Classe E				
2022	188 720	33 163	(48 186)	173 697
2021	124 098	56 126	(17 835)	162 389
Classe F				
2022	115 807	10 270	(11 089)	114 988
2021	103 838	11 526	(10 665)	104 699
Classe G				
2022	33 441	2 403	(6 421)	29 423
2021	28 452	5 878	(3 410)	30 920
Classe I				
2022	11 061	3 528	(8 731)	5 858
2021	10 214	1 412	(558)	11 068
Classe J				
2022	811 165	18 420	(168 512)	661 073
2021	1 060 302	21 665	(208 714)	873 253
Classe K				
2022	649 785	33 672	(26 615)	656 842
2021	819 828	9 400	(98 934)	730 294
Classe L				
2022	129 703	7 906	(3 830)	133 779
2021	131 215	-	(45 156)	86 059
Classe N				
2022	6 066	75	(7)	6 134
2021	3 586	364	(69)	3 881
Actions américaines Beutel Goodman				
Classe A				
2022	184 652	16 691	(27 083)	174 260
2021	207 771	9 736	(24 224)	193 283
Classe B				
2022	101 843	14 829	(16 820)	99 852
2021	125 868	11 092	(22 750)	114 210
Classe E				
2022	956 766	657 771	(269 955)	1 344 582
2021	828 110	250 077	(159 011)	919 176
Classe F				
2022	335 611	28 396	(27 617)	336 390
2021	391 400	49 070	(84 595)	355 875

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions américaines Beutel Goodman (suite)				
Classe G				
2022	229 959	37 048	(29 049)	237 958
2021	287 642	26 365	(69 134)	244 873
Classe I				
2022	94 602	93 922	(18 865)	169 659
2021	27 178	19 492	(15 169)	31 501
Classe J				
2022	122	-	-	122
2021	122	-	-	122
Classe N				
2022	38 018	64 386	(25 154)	77 250
2021	35 819	3 275	(2 557)	36 537
Actions américaines Fiera Capital				
Classe A				
2022	298 784	27 542	(39 009)	287 317
2021	325 991	43 155	(60 595)	308 551
Classe B				
2022	190 762	16 455	(31 565)	175 652
2021	222 045	17 965	(34 434)	205 576
Classe D				
2022	34 788	-	(25 081)	9 707
2021	77 827	865	(25 269)	53 423
Classe E				
2022	2 944 802	540 437	(1 124 560)	2 360 679
2021	2 426 021	729 108	(364 212)	2 790 917
Classe F				
2022	1 395 062	127 167	(269 519)	1 252 710
2021	1 140 619	330 352	(115 801)	1 355 170
Classe G				
2022	674 641	100 686	(91 866)	683 461
2021	653 550	125 358	(101 829)	677 079
Classe H				
2022	299 655	26 275	(24 656)	301 274
2021	314 256	35 172	(35 301)	314 127
Classe I				
2022	313 503	75 876	(71 696)	317 683
2021	219 246	70 262	(26 294)	263 214
Classe J				
2022	34	10 439	(148)	10 325
2021	10 332	-	(37)	10 295
Classe N				
2022	183 178	17 192	(34 658)	165 712
2021	170 238	21 474	(13 330)	178 382
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital				
Classe A				
2022	38 996	5 053	(6 754)	37 295
2021	35 491	3 982	(3 301)	36 172

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital (suite)				
Classe B				
2022	3 162	2 614	(1 945)	3 831
2021	1 769	1 362	(1 393)	1 738
Classe E				
2022	775 979	116 311	(167 022)	725 268
2021	665 012	180 879	(113 181)	732 710
Classe F				
2022	281 755	30 201	(32 909)	279 047
2021	243 133	63 474	(41 644)	264 963
Classe G				
2022	49 385	6 287	(8 665)	47 007
2021	45 381	10 246	(6 165)	49 462
Classe I				
2022	133 609	13 604	(32 150)	115 063
2021	269 516	47 288	(32 557)	284 247
Classe J				
2022	100	-	-	100
2021	100	-	-	100
Classe N				
2022	27 569	946	(1 914)	26 601
2021	28 306	1 467	(968)	28 805
Indice américain BlackRock				
Classe A				
2022	172 629	17 598	(33 216)	157 011
2021	186 332	18 522	(25 493)	179 361
Classe B				
2022	74 166	5 877	(10 298)	69 745
2021	89 667	8 069	(11 587)	86 149
Classe D				
2022	28 997	-	(15 315)	13 682
2021	63 880	76	(25 346)	38 610
Classe E				
2022	1 353 915	154 245	(508 882)	999 278
2021	1 266 825	340 182	(270 876)	1 336 131
Classe F				
2022	346 590	28 330	(56 501)	318 419
2021	398 462	62 535	(83 564)	377 433
Classe G				
2022	111 692	18 581	(28 068)	102 205
2021	141 368	34 323	(55 031)	120 660
Classe H				
2022	196 765	8 950	(14 361)	191 354
2021	211 032	23 101	(25 963)	208 170
Classe I				
2022	392 825	61 220	(81 564)	372 481
2021	332 255	51 929	(25 612)	358 572

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice américain BlackRock (suite)				
Classe J				
2022	82	-	-	82
2021	82	-	-	82
Classe N				
2022	250 541	26 029	(118 705)	157 865
2021	219 399	46 970	(22 385)	243 984
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher				
Classe A				
2022	1 302	115	(101)	1 316
2021	-	500	-	500
Classe B				
2022	495	-	(5)	490
2021	-	500	-	500
Classe E				
2022	57 616	58 982	(9 306)	107 292
2021	-	695	-	695
Classe F				
2022	1 729	11 231	(143)	12 817
2021	-	500	-	500
Classe G				
2022	495	8 122	(43)	8 574
2021	-	500	-	500
Classe I				
2022	100	3 616	(2 758)	958
2021	-	100	-	100
Classe J				
2022	992 789	(1)	(3 872)	988 916
2021	-	1 000 000	(3 410)	996 590
Classe N				
2022	505	1 123	-	1 628
2021	-	500	-	500
Actions internationales GQG Partners				
Classe A				
2022	981	807	(28)	1 760
2021	-	746	-	746
Classe B				
2022	495	2 455	(16)	2 934
2021	-	500	-	500
Classe E				
2022	3 081	703 827	(63 830)	643 078
2021	-	1 432	-	1 432
Classe F				
2022	1 969	12 802	(724)	14 047
2021	-	500	-	500
Classe G				
2022	496	11 370	(1 631)	10 235
2021	-	500	-	500

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions internationales GQG Partners (suite)				
Classe I				
2022	4 837	166 564	(34 035)	137 366
2021	-	100	-	100
Classe J				
2022	1 995 605	231 130	(71 722)	2 155 013
2021	1 427 333	650 585	(49 336)	2 028 582
Classe N				
2022	175 536	165 312	(14 067)	326 781
2021	-	500	-	500
Actions internationales C WorldWide				
Classe A				
2022	124 360	13 515	(21 284)	116 591
2021	117 981	26 493	(18 644)	125 830
Classe B				
2022	45 654	1 437	(4 660)	42 431
2021	54 082	2 771	(6 717)	50 136
Classe D				
2022	7 372	-	(4 528)	2 844
2021	16 743	-	(4 895)	11 848
Classe E				
2022	754 556	99 552	(138 502)	715 606
2021	729 840	165 779	(136 145)	759 474
Classe F				
2022	205 836	7 174	(30 223)	182 787
2021	217 698	49 246	(48 657)	218 287
Classe G				
2022	90 448	3 693	(18 117)	76 024
2021	101 895	15 504	(15 673)	101 726
Classe H				
2022	80 834	2 050	(4 315)	78 569
2021	89 655	4 108	(7 594)	86 169
Classe I				
2022	280 194	21 639	(24 393)	277 440
2021	305 595	62 757	(27 567)	340 785
Classe J				
2022	6 417 232	975 098	(608 881)	6 783 449
2021	5 752 229	955 968	(673 687)	6 034 510
Classe K				
2022	1 464 735	330 648	(90 686)	1 704 697
2021	1 524 246	64 034	(68 184)	1 520 096
Classe L				
2022	103 076	11 265	-	114 341
2021	78 376	29 565	(24 470)	83 471
Classe N				
2022	150 508	66 763	(11 433)	205 838
2021	51 225	97 029	(9 618)	138 636

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice international BlackRock				
Classe A				
2022	17 378	574	(1 667)	16 285
2021	20 051	514	(3 090)	17 475
Classe B				
2022	17 243	931	(459)	17 715
2021	18 276	1 580	(1 632)	18 224
Classe D				
2022	10 653	-	(2 741)	7 912
2021	19 958	274	(4 994)	15 238
Classe E				
2022	179 978	15 174	(8 444)	186 708
2021	176 740	11 945	(12 840)	175 845
Classe F				
2022	38 798	1 227	(1 799)	38 226
2021	41 667	6 972	(10 152)	38 487
Classe G				
2022	16 097	1 779	(2 148)	15 728
2021	22 842	2 193	(4 930)	20 105
Classe H				
2022	154 052	18 761	(4 728)	168 085
2021	161 596	7 495	(16 087)	153 004
Classe I				
2022	14 305	-	(214)	14 091
2021	10 533	1	(154)	10 380
Classe J				
2022	651 180	168 524	(510 054)	309 650
2021	4 635 722	188 358	(1 045 527)	3 778 553
Classe N				
2022	21 105	3 347	(823)	23 629
2021	199 776	31 084	(109 593)	121 267
Actions mondiales dividendes TD				
Classe A				
2022	32 094	5 378	(4 981)	32 491
2021	43 773	5 074	(11 455)	37 392
Classe B				
2022	24 941	1 175	(2 837)	23 279
2021	28 458	615	(2 410)	26 663
Classe E				
2022	553 601	254 484	(144 209)	663 876
2021	557 455	77 122	(104 002)	530 575
Classe F				
2022	303 849	54 930	(38 287)	320 492
2021	357 382	18 288	(52 743)	322 927
Classe G				
2022	100 534	10 238	(13 408)	97 364
2021	135 909	13 079	(37 379)	111 609

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions mondiales dividendes TD (suite)				
Classe I				
2022	30 405	10 928	(10 664)	30 669
2021	36 680	14 339	(11 621)	39 398
Classe J				
2022	402 415	899	(403 261)	53
2021	355 720	104 177	(30 419)	429 478
Classe L				
2022	349 110	4 162	(5 986)	347 286
2021	351 610	9 563	(14 699)	346 474
Classe N				
2022	15 113	19 735	(113)	34 735
2021	17 617	461	(288)	17 790
Actions mondiales Fiera Capital				
Classe A				
2022	104 255	11 424	(12 687)	102 992
2021	102 779	21 254	(19 252)	104 781
Classe B				
2022	164 473	6 385	(9 633)	161 225
2021	193 948	11 314	(39 443)	165 819
Classe D				
2022	8 145	-	(2 570)	5 575
2021	12 426	-	(4 783)	7 643
Classe E				
2022	2 471 447	453 373	(829 533)	2 095 287
2021	2 046 734	589 272	(343 066)	2 292 940
Classe F				
2022	922 551	123 542	(153 448)	892 645
2021	907 538	114 624	(119 271)	902 891
Classe G				
2022	194 504	33 781	(28 350)	199 935
2021	218 157	37 474	(46 540)	209 091
Classe H				
2022	171 134	13 013	(5 365)	178 782
2021	115 657	67 022	(10 833)	171 846
Classe I				
2022	229 747	67 264	(105 334)	191 677
2021	104 373	55 517	(43 119)	116 771
Classe J				
2022	6 830 676	772 669	(1 683 974)	5 919 371
2021	6 339 124	2 552 720	(1 426 966)	7 464 878
Classe L				
2022	243 113	47 419	-	290 532
2021	170 379	41 294	(19 163)	192 510
Classe N				
2022	203 911	35 352	(74 743)	164 520
2021	174 185	64 830	(39 635)	199 380

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions mondiales GQG Partners				
Classe A				
2022	1 637	3 713	(2 322)	3 028
2021	-	500	-	500
Classe B				
2022	495	1 059	(6)	1 548
2021	-	500	-	500
Classe E				
2022	23 227	174 833	(36 374)	161 686
2021	-	500	-	500
Classe F				
2022	5 625	16 094	(452)	21 267
2021	-	1 241	-	1 241
Classe G				
2022	496	8 710	(23)	9 183
2021	-	500	-	500
Classe I				
2022	168 632	11 621	(8 813)	171 440
2021	-	100	-	100
Classe J				
2022	446 041	921 618	(56 122)	1 311 537
2021	668 604	87 955	(55 446)	701 113
Classe N				
2022	39 617	10 671	(3 484)	46 804
2021	27 253	7 887	(836)	34 304
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher				
Classe A				
2022	105 555	6 371	(10 838)	101 088
2021	113 445	9 118	(12 048)	110 515
Classe B				
2022	41 762	1 815	(9 361)	34 216
2021	50 734	4 186	(9 782)	45 138
Classe E				
2022	833 594	100 788	(149 724)	784 658
2021	573 581	359 087	(133 354)	799 314
Classe F				
2022	356 924	39 859	(54 044)	342 739
2021	318 984	116 083	(61 535)	373 532
Classe G				
2022	87 890	10 746	(9 167)	89 469
2021	98 112	17 599	(14 059)	101 652
Classe I				
2022	222 257	29 754	(65 868)	186 143
2021	192 352	36 736	(17 203)	211 885
Classe J				
2022	5 368 218	1 660 445	(358 784)	6 669 879
2021	5 038 500	422 227	(1 047 447)	4 413 280

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher (suite)				
Classe N				
2022	68 698	6 531	(11 965)	63 264
2021	54 903	14 249	(1 519)	67 633
Actions marchés émergents Fisher				
Classe A				
2022	48 039	1 451	(1 049)	48 441
2021	43 989	15 458	(10 062)	49 385
Classe B				
2022	14 671	852	(3 465)	12 058
2021	27 437	3 704	(8 267)	22 874
Classe E				
2022	379 341	50 933	(79 658)	350 616
2021	308 590	208 967	(85 274)	432 283
Classe F				
2022	181 911	9 280	(61 501)	129 690
2021	179 742	67 136	(41 905)	204 973
Classe G				
2022	26 271	461	(4 599)	22 133
2021	27 777	11 135	(6 433)	32 479
Classe I				
2022	69 612	6 128	(4 140)	71 600
2021	112 051	24 328	(27 422)	108 957
Classe J				
2022	4 156 394	1 295 668	(251 086)	5 200 976
2021	4 318 884	691 999	(816 433)	4 194 450
Classe L				
2022	25 561	8 186	-	33 747
2021	2 021	9 904	(100)	11 825
Classe N				
2022	123 107	72 246	(10 753)	184 600
2021	88 292	17 314	(7 945)	97 661
Infrastructures mondiales Lazard				
Classe A				
2022	87 070	11 874	(9 330)	89 614
2021	103 890	9 755	(21 138)	92 507
Classe B				
2022	32 669	1 670	(3 069)	31 270
2021	40 805	5 329	(11 133)	35 001
Classe E				
2022	1 077 518	327 920	(167 151)	1 238 287
2021	1 015 209	214 271	(177 160)	1 052 320
Classe F				
2022	417 676	64 312	(49 768)	432 220
2021	527 350	42 862	(117 483)	452 729
Classe I				
2022	221 118	37 436	(16 595)	241 959
2021	188 316	38 159	(32 231)	194 244

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Infrastructures mondiales Lazard (suite)				
Classe J				
2022	3 474 224	251 907	(1 312 323)	2 413 808
2021	2 406 419	366 677	(203 558)	2 569 538
Classe L				
2022	232 810	29 182	(6 731)	255 261
2021	251 790	24 868	(72 221)	204 437
Classe N				
2022	138 350	51 516	(21 072)	168 794
2021	126 134	15 067	(5 534)	135 667
Immobilier mondial CI				
Classe A				
2022	22 805	568	(884)	22 489
2021	-	25 154	(153)	25 001
Classe B				
2022	7 985	343	(1 463)	6 865
2021	-	10 069	(7)	10 062
Classe E				
2022	144 666	24 539	(30 097)	139 108
2021	-	155 837	(229)	155 608
Classe F				
2022	123 545	4 914	(13 053)	115 406
2021	-	141 878	(1 765)	140 113
Classe I				
2022	60 829	5 094	(2 812)	63 111
2021	-	56 201	(98)	56 103
Classe J				
2022	30 717	443 051	(10 794)	462 974
2021	-	189 475	(1 196)	188 279
Classe L				
2022	78 285	6 444	(3 190)	81 539
2021	-	78 285	-	78 285
Classe N				
2022	123 897	88 923	(8 021)	204 799
2021	-	125 816	(4 645)	121 171

6. FRAIS DE GESTION ET D'ADMINISTRATION

En contrepartie des frais de gestion, la Société fournit des services de conseil en placement et en gestion. La Société perçoit également des Fonds des frais d'administration et prend à sa charge les honoraires d'audit, les honoraires juridiques, les frais d'assurance, les frais de tenue des registres, les frais bancaires, les frais de garde et de dépôt, les frais des services aux souscripteurs de parts, les frais de rapports financiers, les frais de comptabilité et d'évaluation des Fonds, les taxes ainsi que les frais associés à la Notice explicative et à la communication des renseignements aux souscripteurs de parts et tous les autres frais engagés par les Fonds.

Le ratio des frais de gestion (RFG) est établi d'après le total des charges de la période (à l'exclusion des retenues d'impôts et des frais de transactions) indiqué et exprimé en pourcentage annualisé de la moyenne quotidienne de la valeur liquidative au cours de la période. Le RFG de chacun des Fonds est présenté dans la section « informations financières ».

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

7. TRANSACTIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Dans le cours normal des activités, les Fonds versent des frais de gestion à la Société (note 6). Ces frais sont calculés et versés à la Société quotidiennement en fonction de la valeur liquidative des Fonds.

La gestion des Fonds est effectuée par la Société, qui occupe la fonction de principal dirigeant.

Pour la période terminée le 30 juin 2022, un montant total de 26 058 \$ (30 juin 2021 – 25 794 \$) a été transféré par l'ensemble des Fonds à la Société à titre de frais de gestion.

Lors du lancement d'un Fonds, la Société peut injecter des capitaux dans le Fonds. Le tableau suivant présente au 30 juin 2022 et au 31 décembre 2021, les justes valeurs des capitaux de lancement injectés par la Société:

Fonds	30 juin 2022 (\$)	31 décembre 2021 (\$)
Marché monétaire Fiera Capital	10	10
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe	5	5
Stratégie 100 %actions	30	36
Celestia 100 % actions	26	35
Actions américaines Beutel Goodman	2	5
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	13	16
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher	19	33
Actions mondiales GQG Partners	20	28
Actions internationales GQG Partners	18	32

8. RISQUES FINANCIERS LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Dans le cours normal des activités, les Fonds sont exposés à divers risques financiers, dont le risque de crédit, le risque de liquidité, le risque de marché incluant le risque de taux d'intérêt, le risque de prix et le risque de change ainsi que le risque de concentration. Les Fonds sont constitués de placements qui peuvent fluctuer à tous les jours selon l'évolution des marchés, la conjoncture économique, les taux d'intérêt et l'information relative aux sociétés, plus particulièrement celle touchant les titres composant les Fonds ou les fonds sous-jacents.

L'exposition des Fonds aux risques dépend des stratégies de placement ainsi que des types de placement composant les portefeuilles. Les résultats des analyses de sensibilité aux risques auxquels les Fonds sont exposés représentent la meilleure estimation de la direction. Les résultats réels pourraient différer de façon significative.

Une analyse des risques financiers auxquels les Fonds sont exposés est présentée dans les notes spécifiques accompagnant les états financiers de chacun des Fonds.

Risque de crédit

Le risque de crédit correspond au risque de perte financière pour les Fonds si un débiteur ne respecte pas ses engagements. Les placements à revenu fixe et les instruments financiers dérivés sont les principaux instruments financiers sujets au risque de crédit. La valeur comptable représente l'exposition maximale au risque de crédit à la fin de la période.

De plus, les opérations de prêts de titres exposent les Fonds au risque de crédit. Le risque de crédit lié à ces opérations est minime étant donné que la valeur des actifs détenus en garantie par chaque Fonds représente au minimum 102 % de la juste valeur des titres prêtés.

Risque de liquidité

Le risque de liquidité correspond au risque que les Fonds ne soient pas en mesure de respecter leurs obligations en temps opportun en raison de leur incapacité à liquider leurs actifs. Les Fonds sont exposés à ce risque en raison des rachats quotidiens de parts.

Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt correspond au risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des taux d'intérêt en vigueur sur le marché.

Les Fonds sont exposés au risque de taux d'intérêt lorsqu'ils détiennent des instruments financiers portant intérêt. En effet, les Fonds sont exposés au risque que la valeur des instruments financiers fluctue par suite d'une variation des taux d'intérêt sur le marché. Les fluctuations des taux d'intérêt ont peu d'incidence sur la trésorerie et les titres de marché monétaire.

Risque de prix

Le risque de prix correspond au risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations du marché, autres que celles découlant du risque de change ou de taux d'intérêt, que ces variations soient causées par des facteurs propres à l'instrument financier ou à son émetteur, ou par des facteurs affectant tous les instruments financiers similaires négociés sur le marché. Tous les placements de titres peuvent présenter un risque de prix. La juste valeur des placements représente le risque de prix maximal à la fin de la période.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

8. RISQUES FINANCIERS LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS (suite)

Risque de change

Le risque de change correspond au risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier, libellés dans une devise autre que le dollar canadien, fluctuent en raison des variations des cours des devises étrangères. Les Fonds sont exposés au risque de change lorsqu'ils détiennent des éléments d'actif ou de passif libellés dans une devise autre que le dollar canadien, puisque la valeur des titres libellés en devises variera en fonction des taux de change en vigueur.

Risque de concentration

Les concentrations de risque résultent d'instruments financiers qui présentent des caractéristiques similaires et sont affectés de façon similaire par des changements dans la situation économique ou d'autres conditions. Le risque de concentration découle de la concentration des positions dans une même catégorie, que ce soit un emplacement géographique, un type de produit, un secteur d'activité ou un type de contrepartie.

9. GESTION DES RISQUES FINANCIERS

La Société offre des produits d'investissement et de préparation à la retraite et conclut des ententes auprès de gestionnaires externes pour la gestion des Fonds ou des fonds sous-jacents. Par conséquent, la Société ou toute autre entreprise affiliée ne détient aucun intérêt dans une société de gestion de portefeuilles. Ainsi, la gestion des actifs des Fonds est impartie et gérée par l'entremise de gestionnaires externes.

La Société s'est dotée d'une politique de gestion des gestionnaires visant essentiellement à établir un processus rigoureux de sélection et de suivi des gestionnaires externes, incluant les aspects de conformité et de gestion des risques, ainsi que de fournir l'encadrement nécessaire à la prise de décision relativement aux mandats de gestion octroyés aux gestionnaires externes.

La politique définit les responsabilités des intervenants impliqués dans la gestion des Fonds ainsi que le processus décisionnel relativement à la création et au suivi des Fonds.

Processus de sélection des gestionnaires externes

Le processus de recherche et de sélection d'un gestionnaire externe est enclenché pour répondre aux besoins d'un nouveau produit, pour améliorer l'offre des Fonds ou pour remplacer un gestionnaire externe existant. La politique de gestion des gestionnaires externes prévoit les critères d'analyse pour le choix du gestionnaire externe et les étapes du processus de sélection en définissant les niveaux d'approbation requis.

Évaluation de la performance des gestionnaires externes

La Société rencontre régulièrement les gestionnaires externes et effectue un suivi régulier de la performance de chacun afin de réagir rapidement à tout événement susceptible d'avoir un impact sur la performance des Fonds.

Des vérifications mensuelles et trimestrielles sont effectuées. La performance de chacun des gestionnaires externes est comparée avec un indice de référence. L'allocation sectorielle, les principaux titres ainsi que la volatilité du portefeuille des Fonds et des fonds sous-jacents sont analysés. Une mise à jour de l'analyse qualitative de chaque gestionnaire externe est également effectuée périodiquement afin de déceler des mouvements au sein de l'organisation, ainsi que des changements dans le style de gestion et la politique de placement.

La politique de gestion des gestionnaires externes prévoit également les paramètres pouvant éventuellement mener à la remise en question du mandat d'un gestionnaire externe.

Fonds de fonds

La Société a confié la gestion des risques du Fonds au gestionnaire externe du fonds sous-jacent.

La politique de gestion des gestionnaires externes prévoit le suivi et l'évaluation de la performance des gestionnaires des fonds sous-jacents. Ainsi, les vérifications périodiques incluent une analyse de la performance et le suivi qualitatif de chacun des gestionnaires.

10. GESTION DU CAPITAL

Les Fonds ne font l'objet d'aucune restriction ou exigence particulière applicable à la souscription ou au rachat de parts. Les variations du capital survenues durant la période figurent dans l'état de l'évolution de l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs de chacun des Fonds. Le capital est géré conformément aux objectifs de placement des Fonds, ce qui comprend la gestion des liquidités de façon à respecter les obligations en cas de rachat.

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

FAITS SAILLANTS DE NATURE FINANCIÈRE

Le tableau qui suit fait état des données financières clés concernant les Fonds et ont pour objet de vous aider à comprendre leurs résultats pour les cinq derniers exercices. L'actif net détenu pour le compte des souscripteurs est exprimé en milliers de dollars. Le ratio des frais de gestion, exprimé en pourcentage annualisé, est calculé en divisant le total des charges, à l'exclusion des retenues d'impôts et des frais de transaction, par la moyenne quotidienne de l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs au cours de l'exercice.

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Marché monétaire Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe B	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe C	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe E	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe F	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe G	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe I	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe J	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe N	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	34 204	13 972	20 439	12 881	9 134
Nombre de parts en circulation**	3 420 375	1 397 240	2 043 923	1 288 098	913 494
Ratio des frais de gestion, Classe A	1,66	1,64	1,67	1,65	1,65
Ratio des frais de gestion, Classe B	1,65	1,65	1,66	1,65	2,42
Ratio des frais de gestion, Classe C	1,17	1,23	1,51	1,52	1,57
Ratio des frais de gestion, Classe E	1,67	1,63	1,66	1,64	1,63
Ratio des frais de gestion, Classe F	1,65	1,63	1,64	1,62	1,63
Ratio des frais de gestion, Classe G	1,63	1,61	1,64	1,55	1,63
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,04	0,05	0,05	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,04	0,05	0,05	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	1,66	1,64	1,66	1,66	1,65
Obligations court terme Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,48	11,15	11,44	11,01	10,83
Valeur liquidative par part, Classe B	10,21	10,85	11,14	10,72	10,54
Valeur liquidative par part, Classe C	10,51	11,18	11,46	11,02	10,84
Valeur liquidative par part, Classe E	10,49	11,16	11,45	11,02	10,84
Valeur liquidative par part, Classe F	10,51	11,18	11,47	11,04	10,85
Valeur liquidative par part, Classe G	10,45	11,11	11,41	10,98	10,80
Valeur liquidative par part, Classe I	12,02	12,66	12,73	12,00	11,56
Valeur liquidative par part, Classe J	12,02	12,66	12,73	12,00	11,56
Valeur liquidative par part, Classe K	12,02	12,66	12,73	12,00	11,56
Valeur liquidative par part, Classe N	10,48	11,15	11,44	11,01	10,83
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	59 892	58 844	72 800	65 198	53 724
Nombre de parts en circulation**	5 123 167	4 779 071	5 874 766	5 517 373	4 704 968
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,18	2,07	2,07	2,07	2,07
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,17	2,06	2,06	2,07	2,92

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Obligations court terme Fiera Capital (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,08	1,97	1,99	2,03	2,03
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,16	2,05	2,05	2,05	2,05
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,16	2,05	2,05	2,02	2,01
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,17	2,06	2,06	2,06	2,16
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,11	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,11	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,11	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,18	2,07	2,07	2,07	2,07
Obligations Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,33	12,02	12,66	11,72	11,25
Valeur liquidative par part, Classe B	10,05	11,69	12,31	11,40	10,94
Valeur liquidative par part, Classe C	10,35	12,05	12,68	11,74	11,27
Valeur liquidative par part, Classe D	10,22	11,89	12,52	11,59	11,12
Valeur liquidative par part, Classe E	10,36	12,05	12,69	11,74	11,27
Valeur liquidative par part, Classe F	10,35	12,04	12,68	11,73	11,26
Valeur liquidative par part, Classe G	10,32	12,00	12,63	11,69	11,22
Valeur liquidative par part, Classe H	10,22	11,89	12,52	11,59	11,12
Valeur liquidative par part, Classe I	12,01	13,82	14,23	12,88	12,09
Valeur liquidative par part, Classe J	12,01	13,82	14,23	12,88	12,09
Valeur liquidative par part, Classe K	12,01	13,82	14,23	12,88	12,09
Valeur liquidative par part, Classe N	10,35	12,04	12,68	11,74	11,27
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	238 495	297 974	350 516	333 883	311 676
Nombre de parts en circulation**	20 372 426	22 135 893	25 230 154	26 346 595	26 141 307
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,28	2,27	2,29	2,29	2,33
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,29	2,28	2,29	2,29	3,21
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,28	2,27	2,28	2,29	2,27
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,29	2,28	2,29	2,30	2,68
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,27	2,26	2,27	2,27	2,27
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,26	2,25	2,26	2,27	2,30
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,27	2,26	2,27	2,27	2,41
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,29	2,28	2,29	2,30	2,68
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,04	0,05	0,05	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,04	0,05	0,05	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,05	0,04	0,05	0,05	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,29	2,28	2,29	2,29	2,28
Obligations PIMCO					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,91	11,52	12,04	11,06	10,49
Valeur liquidative par part, Classe B	9,64	11,21	11,71	10,75	10,20
Valeur liquidative par part, Classe C	9,93	11,55	12,06	11,08	10,51
Valeur liquidative par part, Classe E	9,93	11,55	12,06	11,07	10,51
Valeur liquidative par part, Classe F	9,92	11,54	12,05	11,06	10,49
Valeur liquidative par part, Classe G	9,89	11,50	12,01	11,03	10,46

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Obligations PIMCO (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe I	11,60	13,34	13,61	12,21	11,31
Valeur liquidative par part, Classe J	11,60	13,34	13,61	12,21	11,31
Valeur liquidative par part, Classe L	10,35	11,91	12,15	10,90	10,10
Valeur liquidative par part, Classe N	9,92	11,54	12,06	11,07	10,50
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	83 637	103 219	121 286	104 953	105 671
Nombre de parts en circulation**	7 648 618	8 177 301	9 334 745	8 873 661	9 567 659
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,40	2,43	2,45	2,46	2,50
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,39	2,42	2,45	2,45	3,38
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,39	2,42	2,45	2,44	2,45
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,39	2,42	2,45	2,45	2,45
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,38	2,41	2,44	2,44	2,49
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,36	2,39	2,43	2,44	2,59
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,10	0,10	0,10	0,10	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,10	0,10	0,10	0,10	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,10	0,10	0,10	0,10	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,40	2,42	2,45	2,46	2,46
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,54	10,52	10,77	10,33	9,87
Valeur liquidative par part, Classe B	9,50	10,47	10,72	10,28	9,82
Valeur liquidative par part, Classe E	9,55	10,53	10,78	10,33	9,88
Valeur liquidative par part, Classe F	9,55	10,53	10,78	10,33	9,87
Valeur liquidative par part, Classe G	9,54	10,52	10,77	10,32	9,86
Valeur liquidative par part, Classe I	10,55	11,49	11,47	10,73	10,01
Valeur liquidative par part, Classe J	10,55	11,49	11,47	10,73	10,01
Valeur liquidative par part, Classe N	9,55	10,53	10,78	10,33	9,88
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	83 634	105 533	85 050	57 396	60 667
Nombre de parts en circulation**	8 045 587	9 260 877	7 467 328	5 379 146	6 068 522
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,50	2,50	2,51	2,51	2,65
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,50	2,50	2,51	2,51	3,54
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,49	2,50	2,51	2,50	2,55
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,49	2,49	2,50	2,48	2,64
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,48	2,49	2,50	2,47	2,79
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,03	0,04	0,04	0,08
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,03	0,04	0,04	0,08
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,50	2,50	2,51	2,51	2,55
Obligations mondiales PIMCO					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,48	11,34	11,60	11,24	10,77
Valeur liquidative par part, Classe B	10,19	11,02	11,28	10,92	10,47
Valeur liquidative par part, Classe C	10,51	11,37	11,64	11,27	10,81
Valeur liquidative par part, Classe E	10,52	11,38	11,64	11,28	10,81
Valeur liquidative par part, Classe F	10,50	11,36	11,62	11,25	10,79
Valeur liquidative par part, Classe G	10,45	11,30	11,56	11,19	10,72

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Obligations mondiales PIMCO (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe I	12,62	13,47	13,41	12,64	11,78
Valeur liquidative par part, Classe J	12,62	13,47	13,41	12,64	11,79
Valeur liquidative par part, Classe L	10,76	11,49	11,43	10,77	10,05
Valeur liquidative par part, Classe N	10,51	11,37	11,63	11,27	10,80
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	45 724	55 816	67 623	69 726	51 233
Nombre de parts en circulation**	3 870 003	4 399 451	5 257 090	5 688 445	4 506 749
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,76	2,76	2,76	2,76	2,86
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,74	2,74	2,75	2,75	3,75
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,76	2,75	2,75	2,75	2,75
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,75	2,75	2,75	2,75	2,75
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,71	2,72	2,71	2,73	2,83
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,71	2,67	2,70	2,75	3,00
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,76	2,76	2,76	2,76	2,76
Obligations de sociétés CI					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,38	11,75	11,52	11,04	10,23
Valeur liquidative par part, Classe B	10,18	11,53	11,31	10,83	10,04
Valeur liquidative par part, Classe E	10,41	11,78	11,55	11,06	10,25
Valeur liquidative par part, Classe F	10,40	11,77	11,54	11,05	10,23
Valeur liquidative par part, Classe G	10,36	11,72	11,49	11,01	10,20
Valeur liquidative par part, Classe I	12,10	13,52	12,91	12,03	10,85
Valeur liquidative par part, Classe J	12,10	13,52	12,91	12,03	10,85
Valeur liquidative par part, Classe N	10,40	11,77	11,55	11,06	10,25
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	30 876	36 665	26 605	24 610	25 459
Nombre de parts en circulation**	2 846 919	2 974 696	2 251 561	2 186 941	2 446 048
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,70	2,70	2,70	2,70	2,80
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,70	2,70	2,70	2,70	3,70
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,66	2,66	2,69	2,69	2,70
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,64	2,63	2,65	2,65	2,77
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,66	2,66	2,67	2,68	2,93
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,70	2,70	2,70	2,70	2,70
Indice obligataire BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,45	12,05	12,64	11,88	11,37
Valeur liquidative par part, Classe B	10,17	11,72	12,30	11,56	11,06
Valeur liquidative par part, Classe C	10,47	12,07	12,66	11,90	11,39
Valeur liquidative par part, Classe E	10,48	12,08	12,67	11,91	11,39
Valeur liquidative par part, Classe F	10,48	12,08	12,67	11,90	11,38
Valeur liquidative par part, Classe G	10,44	12,02	12,61	11,85	11,34

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Indice obligataire BlackRock (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe I	12,15	13,85	14,21	13,06	12,22
Valeur liquidative par part, Classe J	12,15	13,85	14,21	13,06	12,22
Valeur liquidative par part, Classe N	10,50	12,09	12,69	11,92	11,40
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	40 459	65 834	26 082	35 299	38 984
Nombre de parts en circulation**	3 374 737	4 800 845	1 882 412	2 726 953	3 209 394
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,25	2,25	2,25	2,25	2,30
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,25	2,25	2,25	2,24	3,18
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,23	2,23	2,25	2,25	2,25
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,21	2,22	2,22	2,23	2,24
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,13	2,22	2,20	2,19	2,24
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,09	2,24	2,24	2,24	2,36
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,20	2,21	2,20	2,21	2,21
Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,94	10,97	10,40	10,15	-
Valeur liquidative par part, Classe B	9,95	10,98	10,40	10,15	-
Valeur liquidative par part, Classe C	9,96	10,99	10,41	10,15	-
Valeur liquidative par part, Classe E	9,95	10,98	10,40	10,15	-
Valeur liquidative par part, Classe F	9,96	11,00	10,41	10,15	-
Valeur liquidative par part, Classe G	9,96	10,99	10,40	10,15	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,76	11,72	10,82	10,29	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,76	11,72	10,82	10,29	-
Valeur liquidative par part, Classe N	9,95	10,98	10,40	10,15	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 338	21 722	25 417	22 153	-
Nombre de parts en circulation**	2 032 402	1 968 068	2 438 473	2 181 120	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,62	2,62	2,62	2,62	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,61	2,61	2,61	2,60	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,55	2,55	2,55	2,55	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,61	2,61	2,61	2,61	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,60	2,56	2,54	2,52	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,59	2,55	2,57	2,60	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,03	0,04	0,04	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,03	0,04	0,04	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,62	2,62	2,63	2,62	-
Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,03	11,08	10,13	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,03	11,08	10,13	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe C	10,03	11,09	10,13	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,03	11,09	10,13	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,06	11,12	10,15	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,04	11,09	10,13	10,18	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Portefeuille bêta intelligent plus – équilibré (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe I	10,87	11,85	10,55	10,33	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,87	11,85	10,55	10,33	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,03	11,08	10,13	10,18	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 425	31 827	39 176	39 523	-
Nombre de parts en circulation**	2 721 455	2 863 595	3 863 176	3 881 771	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,67	2,68	2,68	2,67	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,67	2,67	2,68	2,68	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,65	2,66	2,66	2,66	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,66	2,66	2,66	2,66	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,59	2,57	2,55	2,55	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,64	2,64	2,65	2,65	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,04	0,04	0,04	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,04	0,04	0,04	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,68	2,68	2,68	2,68	-
Portefeuille bêta intelligent plus - croissance					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,02	11,05	9,93	10,17	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,01	11,04	9,93	10,17	-
Valeur liquidative par part, Classe C	10,02	11,04	9,93	10,17	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,03	11,05	9,94	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,06	11,08	9,95	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,04	11,06	9,94	10,18	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,87	11,83	10,35	10,32	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,87	11,82	10,35	10,32	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,01	11,04	9,93	10,17	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	9 574	11 273	13 669	19 399	-
Nombre de parts en circulation**	953 193	1 019 660	1 374 952	1 906 223	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,72	2,71	2,71	2,71	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,73	2,73	2,73	2,73	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,72	2,71	2,72	2,71	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,70	2,69	2,68	2,68	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,60	2,57	2,59	2,60	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,66	2,66	2,65	2,66	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,04	0,04	0,04	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,04	0,04	0,04	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,74	2,74	2,74	2,74	-
Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,08	11,10	9,81	10,19	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,08	11,10	9,81	10,19	-
Valeur liquidative par part, Classe C	10,09	11,11	9,82	10,19	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,08	11,10	9,81	10,19	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,11	11,12	9,82	10,19	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,08	11,10	9,81	10,19	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Portefeuille bêta intelligent plus – audacieux (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe I	10,96	11,90	10,24	10,34	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,96	11,90	10,24	10,34	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,09	11,10	9,81	10,19	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	6 849	7 868	10 100	11 383	-
Nombre de parts en circulation**	676 707	706 889	1 027 822	1 116 797	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,78	2,78	2,79	2,79	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,79	2,79	2,79	2,79	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,74	2,75	2,74	2,74	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,78	2,78	2,77	2,77	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,69	2,69	2,70	2,71	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,75	2,78	2,78	2,78	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,03	0,03	0,03	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,03	0,03	0,03	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,76	2,76	2,78	2,79	-
Stratégie sécuritaire					
Valeur liquidative par part, Classe A	13,02	14,83	14,20	13,33	12,27
Valeur liquidative par part, Classe B	12,64	14,41	13,80	12,95	11,92
Valeur liquidative par part, Classe C	13,10	14,93	14,29	13,41	12,35
Valeur liquidative par part, Classe E	13,10	14,93	14,30	13,42	12,35
Valeur liquidative par part, Classe F	13,05	14,87	14,24	13,36	12,30
Valeur liquidative par part, Classe G	12,97	14,78	14,15	13,28	12,22
Valeur liquidative par part, Classe I	15,67	17,62	16,43	15,00	13,45
Valeur liquidative par part, Classe J	15,72	17,67	16,47	15,05	13,48
Valeur liquidative par part, Classe L	13,96	15,69	14,63	13,36	11,97
Valeur liquidative par part, Classe N	13,10	14,93	14,29	13,42	12,35
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	100 823	143 753	122 962	118 163	109 954
Nombre de parts en circulation**	7 665 678	9 568 907	8 618 066	8 836 230	8 950 765
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,73	2,72	2,73	2,73	2,94
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,74	2,72	2,73	2,73	3,86
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,73	2,72	2,73	2,73	2,74
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,73	2,72	2,72	2,72	2,73
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,70	2,70	2,72	2,72	2,88
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,71	2,70	2,71	2,71	3,07
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,03	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,74	2,72	2,73	2,73	2,74
Stratégie équilibrée					
Valeur liquidative par part, Classe A	14,12	16,49	15,12	13,91	12,42
Valeur liquidative par part, Classe B	13,79	16,10	14,76	13,57	12,12
Valeur liquidative par part, Classe C	14,28	16,68	15,29	14,06	12,56
Valeur liquidative par part, Classe E	14,28	16,68	15,29	14,06	12,56

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Stratégie équilibrée (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe F	14,16	16,53	15,15	13,93	12,45
Valeur liquidative par part, Classe G	14,00	16,35	14,98	13,78	12,31
Valeur liquidative par part, Classe I	17,15	19,75	17,62	15,76	13,70
Valeur liquidative par part, Classe J	17,15	19,75	17,62	15,76	13,70
Valeur liquidative par part, Classe L	15,46	17,81	15,88	14,21	12,35
Valeur liquidative par part, Classe N	14,28	16,67	15,29	14,06	12,56
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	215 840	251 840	240 885	227 518	212 567
Nombre de parts en circulation**	14 936 289	14 960 589	15 551 704	16 064 650	16 909 691
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,79	2,78	2,79	2,79	3,15
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,79	2,78	2,78	2,79	3,92
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,79	2,78	2,78	2,78	2,79
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,78	2,78	2,78	2,78	2,79
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,76	2,77	2,77	2,78	3,09
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,77	2,77	2,77	2,77	3,44
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,03	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,79	2,78	2,78	2,79	2,80
Stratégie croissance					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,77	19,87	17,66	16,14	14,14
Valeur liquidative par part, Classe B	16,45	19,49	17,32	15,82	13,86
Valeur liquidative par part, Classe C	17,03	20,18	17,94	16,39	14,36
Valeur liquidative par part, Classe E	17,04	20,19	17,94	16,40	14,36
Valeur liquidative par part, Classe F	16,83	19,94	17,72	16,19	14,18
Valeur liquidative par part, Classe G	16,58	19,64	17,45	15,94	13,96
Valeur liquidative par part, Classe I	20,54	24,00	20,74	18,42	15,69
Valeur liquidative par part, Classe J	20,64	24,12	20,84	18,51	15,77
Valeur liquidative par part, Classe L	16,69	19,51	16,86	14,97	12,75
Valeur liquidative par part, Classe N	17,04	20,18	17,94	16,39	14,36
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	71 654	84 129	75 742	63 534	56 666
Nombre de parts en circulation**	4 238 740	4 212 140	4 301 564	3 961 747	4 053 035
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,84	2,84	2,84	2,85	3,35
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,83	2,84	2,84	2,84	3,97
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,84	2,84	2,84	2,85	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,83	2,83	2,84	2,84	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,80	2,81	2,83	2,84	3,25
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,81	2,82	2,82	2,82	3,73
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,02	0,03	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,84	2,84	2,84	2,85	2,85

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Stratégie audacieuse					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,10	19,19	16,69	15,26	13,22
Valeur liquidative par part, Classe B	15,72	18,73	16,30	14,90	12,91
Valeur liquidative par part, Classe C	16,36	19,49	16,96	15,50	13,43
Valeur liquidative par part, Classe E	16,36	19,50	16,96	15,51	13,43
Valeur liquidative par part, Classe F	16,15	19,24	16,72	15,28	13,23
Valeur liquidative par part, Classe G	15,85	18,89	16,43	15,02	13,00
Valeur liquidative par part, Classe I	19,87	23,34	19,72	17,51	14,73
Valeur liquidative par part, Classe J	19,98	23,46	19,82	17,60	14,81
Valeur liquidative par part, Classe L	17,85	20,97	17,71	15,73	13,23
Valeur liquidative par part, Classe N	16,36	19,49	16,96	15,50	13,43
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	38 352	45 829	40 399	34 707	31 690
Nombre de parts en circulation**	2 311 382	2 325 778	2 371 807	2 240 598	2 375 263
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,95	2,95	2,96	2,96	3,46
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,95	2,95	2,96	2,96	4,22
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,95	2,95	2,95	2,96	2,96
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,95	2,95	2,95	2,95	2,95
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,86	2,87	2,88	2,91	3,44
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,92	2,93	2,93	2,93	3,98
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	0,02	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	0,02	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,02	0,02	0,03	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,95	2,95	2,96	2,96	2,97
Stratégie 100% actions					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,10	10,94	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	9,10	10,94	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	9,10	10,94	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	9,10	10,94	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	9,10	10,94	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	9,40	11,13	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	9,40	11,13	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	9,40	11,13	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	9,10	10,94	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	328	51	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	36 015	4 621	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,12	3,11	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,11	3,11	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,12	3,12	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,12	3,11	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,12	3,11	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,02	-	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Stratégie 100% actions (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,11	3,11	-	-	-
Celestia sécuritaire					
Valeur liquidative par part, Classe A	12,91	14,51	13,64	13,13	12,07
Valeur liquidative par part, Classe B	12,56	14,11	13,26	12,77	11,74
Valeur liquidative par part, Classe C	13,01	14,62	13,74	13,23	12,16
Valeur liquidative par part, Classe E	13,02	14,62	13,74	13,23	12,16
Valeur liquidative par part, Classe F	12,95	14,54	13,67	13,16	12,09
Valeur liquidative par part, Classe G	12,85	14,43	13,56	13,05	11,99
Valeur liquidative par part, Classe I	15,68	17,38	15,88	14,87	13,28
Valeur liquidative par part, Classe J	15,74	17,44	15,94	14,92	13,34
Valeur liquidative par part, Classe N	13,01	14,62	13,74	13,23	12,16
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	86 204	75 421	79 317	87 543	87 624
Nombre de parts en circulation**	6 582 329	5 171 318	5 790 729	6 637 993	7 231 054
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,86	2,85	2,85	2,85	3,10
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,86	2,85	2,85	2,85	3,98
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,86	2,84	2,85	2,85	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,85	2,84	2,85	2,85	2,86
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,82	2,81	2,81	2,84	3,05
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,81	2,80	2,81	2,83	3,29
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,86	2,85	2,85	2,85	2,86
Celestia équilibré					
Valeur liquidative par part, Classe A	13,73	15,46	13,86	13,69	12,31
Valeur liquidative par part, Classe B	13,45	15,13	13,57	13,41	12,06
Valeur liquidative par part, Classe C	13,93	15,68	14,06	13,89	12,49
Valeur liquidative par part, Classe E	13,93	15,68	14,06	13,89	12,49
Valeur liquidative par part, Classe F	13,81	15,54	13,92	13,75	12,36
Valeur liquidative par part, Classe G	13,63	15,33	13,74	13,58	12,21
Valeur liquidative par part, Classe I	16,87	18,72	16,30	15,65	13,67
Valeur liquidative par part, Classe J	16,96	18,82	16,39	15,74	13,75
Valeur liquidative par part, Classe N	13,93	15,67	14,05	13,89	12,49
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	97 590	110 881	110 701	131 759	130 032
Nombre de parts en circulation**	6 985 504	7 080 505	7 900 879	9 520 679	10 464 717
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,97	2,96	2,97	2,97	3,43
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,97	2,96	2,97	2,97	4,10
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,97	2,96	2,97	2,97	2,97
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,97	2,96	2,97	2,97	2,97
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,93	2,91	2,93	2,95	3,30
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,94	2,94	2,95	2,95	3,70
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,06	0,09	0,09	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,06	0,09	0,09	0,10

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Celestia équilibré (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,98	2,97	2,97	2,98	2,98
Celestia croissance					
Valeur liquidative par part, Classe A	14,75	16,63	14,42	14,48	12,82
Valeur liquidative par part, Classe B	14,48	16,33	14,15	14,21	12,58
Valeur liquidative par part, Classe C	14,99	16,90	14,66	14,72	13,03
Valeur liquidative par part, Classe E	15,01	16,92	14,67	14,73	13,04
Valeur liquidative par part, Classe F	14,82	16,70	14,47	14,53	12,86
Valeur liquidative par part, Classe G	14,58	16,43	14,25	14,31	12,66
Valeur liquidative par part, Classe I	18,21	20,23	17,04	16,61	14,29
Valeur liquidative par part, Classe J	18,33	20,37	17,15	16,73	14,38
Valeur liquidative par part, Classe N	14,99	16,90	14,65	14,72	13,03
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	42 417	45 526	40 641	50 186	46 765
Nombre de parts en circulation**	2 825 651	2 703 739	2 784 875	3 424 953	3 606 986
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,03	3,03	3,03	3,04	3,54
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,01	3,00	3,01	3,02	4,16
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,03	3,02	3,03	3,03	3,04
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,01	3,01	3,01	3,02	3,02
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,96	2,96	2,99	3,00	3,46
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,01	3,01	3,01	3,02	3,96
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,07	0,11	0,11	0,12
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,07	0,11	0,11	0,12
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,04	3,03	3,04	3,04	3,04
Celestia audacieux					
Valeur liquidative par part, Classe A	15,27	17,28	14,53	14,73	12,85
Valeur liquidative par part, Classe B	14,89	16,85	14,18	14,37	12,55
Valeur liquidative par part, Classe C	15,49	17,53	14,75	14,95	13,05
Valeur liquidative par part, Classe D	14,90	16,85	14,18	14,38	12,55
Valeur liquidative par part, Classe E	15,52	17,56	14,77	14,98	13,07
Valeur liquidative par part, Classe F	15,24	17,24	14,50	14,70	12,82
Valeur liquidative par part, Classe G	14,89	16,84	14,17	14,36	12,53
Valeur liquidative par part, Classe H	14,54	16,46	13,85	14,04	12,25
Valeur liquidative par part, Classe I	18,88	21,05	17,19	16,91	14,33
Valeur liquidative par part, Classe J	19,03	21,21	17,32	17,05	14,44
Valeur liquidative par part, Classe N	15,49	17,53	14,75	14,95	13,05
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 336	32 218	31 024	32 624	31 764
Nombre de parts en circulation**	1 775 560	1 851 206	2 124 566	2 213 418	2 464 165
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,10	3,06	3,06	3,08	3,58
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,10	3,09	3,09	3,10	4,35
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,09	3,09	3,09	3,10	3,10
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,07	3,08	3,09	3,09	4,35
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,07	3,06	3,07	3,07	3,07
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,06	3,06	3,06	3,07	3,67

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Celestia audacieux (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,08	3,07	3,07	3,07	4,38
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,10	3,09	3,09	3,10	5,10
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,08	0,12	0,12	0,13
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,08	0,12	0,12	0,13
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,09	3,09	3,09	3,10	3,10
Célestia 100% actions					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,55	10,83	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	9,55	10,83	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	9,55	10,83	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	9,55	10,83	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	9,55	10,83	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	9,87	11,01	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	9,87	11,01	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	9,55	10,83	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	603	292	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	63 103	26 979	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,21	3,20	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,21	3,19	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,21	3,21	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,20	3,19	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,20	3,20	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,05	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,05	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,21	3,20	-	-	-
Revenu sécuritaire Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,25	10,68	10,11	9,57	9,10
Valeur liquidative par part, Classe B	8,89	10,26	9,71	9,18	8,75
Valeur liquidative par part, Classe C	9,35	10,79	10,22	9,67	9,19
Valeur liquidative par part, Classe E	9,36	10,81	10,23	9,67	9,19
Valeur liquidative par part, Classe F	9,28	10,71	10,14	9,59	9,11
Valeur liquidative par part, Classe G	9,19	10,60	10,03	9,49	9,02
Valeur liquidative par part, Classe I	11,34	12,92	11,90	10,95	10,09
Valeur liquidative par part, Classe J	13,14	14,96	13,78	12,68	11,33
Valeur liquidative par part, Classe L	13,37	15,23	14,02	12,90	11,53
Valeur liquidative par part, Classe N	9,35	10,80	10,22	9,67	9,19
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 102	24 518	25 442	27 194	22 052
Nombre de parts en circulation**	2 127 354	2 256 690	2 480 190	2 807 219	2 398 512
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,94	2,94	2,94	2,95	3,25
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,93	2,93	2,94	2,95	4,44
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,94	2,94	2,94	2,95	2,94
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,92	2,92	2,92	2,93	2,92
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,90	2,90	2,90	2,91	3,20

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Revenu sécuritaire Guardian (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,90	2,89	2,89	2,90	3,48
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,18	0,18	0,18	0,19	0,18
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,18	0,18	0,18	0,19	0,18
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,18	0,18	0,18	0,19	0,18
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,94	2,94	2,94	2,95	2,93
Revenu Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,80	11,42	10,31	9,85	9,17
Valeur liquidative par part, Classe B	9,46	11,02	9,94	9,49	8,85
Valeur liquidative par part, Classe C	9,97	11,62	10,49	10,02	9,33
Valeur liquidative par part, Classe E	9,99	11,64	10,51	10,04	9,34
Valeur liquidative par part, Classe F	9,86	11,49	10,37	9,90	9,22
Valeur liquidative par part, Classe G	9,69	11,29	10,19	9,73	9,06
Valeur liquidative par part, Classe I	12,12	13,93	12,23	11,36	10,25
Valeur liquidative par part, Classe J	14,03	16,12	14,15	13,15	11,51
Valeur liquidative par part, Classe L	14,30	16,44	14,43	13,41	11,74
Valeur liquidative par part, Classe N	10,06	11,73	10,59	10,12	9,41
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	26 166	31 524	32 769	38 206	36 993
Nombre de parts en circulation**	2 608 546	2 698 958	3 115 660	3 807 764	3 966 398
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,01	3,02	3,02	3,02	3,54
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,94	2,92	3,00	3,01	4,61
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,97	2,98	3,02	3,04	3,04
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,99	2,99	3,00	2,99	2,98
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,98	2,98	2,99	2,98	3,39
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,97	2,96	2,97	2,97	3,90
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,21	0,21	0,22	0,22	0,22
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,21	0,21	0,22	0,22	0,22
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,21	0,21	0,22	0,22	0,22
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,03	3,03	3,04	3,04	3,04
Répartition d'actifs canadiens CI					
Valeur liquidative par part, Classe A	6,96	8,21	7,52	7,38	6,87
Valeur liquidative par part, Classe B	6,81	8,03	7,35	7,22	6,73
Valeur liquidative par part, Classe C	7,08	8,35	7,65	7,50	6,99
Valeur liquidative par part, Classe E	7,11	8,38	7,67	7,52	7,00
Valeur liquidative par part, Classe F	6,96	8,21	7,51	7,36	6,85
Valeur liquidative par part, Classe G	6,78	7,99	7,31	7,16	6,68
Valeur liquidative par part, Classe I	8,62	10,02	8,92	8,51	7,68
Valeur liquidative par part, Classe J	10,07	11,71	10,43	9,95	8,68
Valeur liquidative par part, Classe L	14,48	16,83	14,98	14,30	12,47
Valeur liquidative par part, Classe N	7,08	8,35	7,64	7,50	6,99
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	60 105	74 520	77 386	93 422	101 338
Nombre de parts en circulation**	8 263 308	8 715 978	9 933 041	12 210 704	14 303 347
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,96	2,98	2,96	2,96	3,48

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Répartition d'actifs canadiens CI (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,96	2,98	2,96	2,96	4,10
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,96	2,98	2,96	2,96	2,98
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,91	2,93	2,90	2,91	2,93
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,86	2,88	2,86	2,86	3,57
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,87	2,89	2,88	2,89	4,32
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,15	0,17	0,15	0,15	0,17
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,15	0,17	0,15	0,15	0,17
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,15	0,17	0,15	0,15	0,17
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,97	2,99	2,97	2,97	2,99
Revenu et croissance mondial CI					
Valeur liquidative par part, Classe A	6,76	8,00	7,10	6,37	5,99
Valeur liquidative par part, Classe B	6,59	7,80	6,92	6,20	5,84
Valeur liquidative par part, Classe C	6,88	8,14	7,23	6,48	6,09
Valeur liquidative par part, Classe E	6,90	8,17	7,25	6,49	6,10
Valeur liquidative par part, Classe F	6,74	7,98	7,08	6,34	5,96
Valeur liquidative par part, Classe G	6,56	7,76	6,89	6,17	5,81
Valeur liquidative par part, Classe I	8,62	10,04	8,64	7,49	6,79
Valeur liquidative par part, Classe J	10,36	12,07	10,38	9,01	7,86
Valeur liquidative par part, Classe L	18,82	21,93	18,85	16,36	14,27
Valeur liquidative par part, Classe N	6,87	8,14	7,22	6,47	6,09
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	194 968	235 055	194 770	181 364	168 751
Nombre de parts en circulation**	26 411 279	26 970 930	25 290 513	26 575 671	26 629 853
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,20	3,20	3,20	3,20	3,70
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,21	3,21	3,21	3,21	4,43
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,21	3,20	3,21	3,21	3,21
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,18	3,17	3,17	3,17	3,17
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,15	3,14	3,13	3,13	3,87
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,12	3,14	3,15	3,15	4,60
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,22	3,22	3,22	3,22	3,22
Actions canadiennes dividendes Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,30	16,57	13,07	14,32	12,19
Valeur liquidative par part, Classe B	15,84	16,11	12,71	13,92	11,85
Valeur liquidative par part, Classe E	16,59	16,87	13,30	14,57	12,40
Valeur liquidative par part, Classe F	16,23	16,50	13,00	14,23	12,10
Valeur liquidative par part, Classe G	15,92	16,17	12,73	13,93	11,84
Valeur liquidative par part, Classe I	19,73	19,80	15,21	16,24	13,46
Valeur liquidative par part, Classe J	19,73	19,80	15,21	16,24	13,46
Valeur liquidative par part, Classe L	16,41	16,47	12,65	13,50	11,20
Valeur liquidative par part, Classe N	16,55	16,83	13,28	14,55	12,39

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions canadiennes dividendes Guardian (suite)					
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	78 892	67 154	62 166	63 291	70 214
Nombre de parts en circulation**	4 725 988	3 856 937	4 574 994	4 409 072	5 805 961
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,85	2,84	2,84	2,84	3,35
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,85	2,84	2,84	2,84	4,25
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,82	2,80	2,80	2,80	2,83
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,77	2,74	2,73	2,72	3,58
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,70	2,67	2,66	2,67	4,25
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,21	0,20	0,20	0,20	0,21
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,21	0,20	0,20	0,20	0,21
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,21	0,20	0,20	0,20	0,21
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,85	2,84	2,84	2,84	2,85
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée					
Valeur liquidative par part, Classe A	26,75	32,80	27,07	26,60	22,71
Valeur liquidative par part, Classe B	25,86	31,70	26,16	25,71	21,95
Valeur liquidative par part, Classe D	25,85	31,70	26,16	25,71	21,95
Valeur liquidative par part, Classe E	27,20	33,35	27,52	27,04	23,08
Valeur liquidative par part, Classe F	26,55	32,55	26,85	26,38	22,51
Valeur liquidative par part, Classe G	25,92	31,78	26,22	25,76	21,98
Valeur liquidative par part, Classe H	25,12	30,80	25,41	24,97	21,32
Valeur liquidative par part, Classe I	32,76	39,62	31,79	30,37	25,20
Valeur liquidative par part, Classe J	32,76	39,62	31,79	30,37	25,20
Valeur liquidative par part, Classe N	27,18	33,33	27,50	27,03	23,07
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	198 731	250 138	249 410	222 003	194 152
Nombre de parts en circulation**	6 493 906	6 729 673	8 220 911	7 674 666	8 044 759
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,82	2,82	2,82	2,82	3,31
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,82	2,82	2,82	2,82	4,40
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,82	2,82	2,82	2,82	4,40
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,81	2,81	2,80	2,81	2,81
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,78	2,79	2,79	2,80	3,60
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,80	2,80	2,79	2,79	4,34
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,82	2,82	2,82	2,82	5,32
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	0,01	-	0,01	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	0,01	-	0,01	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,82	2,82	2,82	2,82	2,82
Actions canadiennes Triasima					
Valeur liquidative par part, Classe A	19,18	21,67	17,55	16,83	13,94
Valeur liquidative par part, Classe B	18,61	21,02	17,02	16,32	13,52
Valeur liquidative par part, Classe D	18,56	20,96	16,97	16,27	13,48
Valeur liquidative par part, Classe E	19,50	22,03	17,84	17,10	14,17
Valeur liquidative par part, Classe F	19,12	21,59	17,47	16,73	13,85
Valeur liquidative par part, Classe G	18,64	21,05	17,03	16,31	13,51
Valeur liquidative par part, Classe H	18,02	20,36	16,48	15,80	13,09

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions canadiennes Triasima (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe I	23,49	26,18	20,61	19,21	15,48
Valeur liquidative par part, Classe J	23,49	26,18	20,61	19,21	15,48
Valeur liquidative par part, Classe K	23,49	26,18	20,61	19,21	15,48
Valeur liquidative par part, Classe L	14,29	15,92	12,54	11,69	9,41
Valeur liquidative par part, Classe N	19,49	22,02	17,83	17,09	14,16
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	261 142	312 617	301 895	302 679	265 151
Nombre de parts en circulation**	11 566 220	12 353 479	14 980 113	16 054 351	17 402 419
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,81	2,81	2,81	2,81	3,31
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,80	2,80	2,80	2,81	4,29
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,76	2,79	2,80	2,80	4,38
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,81	2,80	2,80	2,80	2,81
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,71	2,72	2,72	2,73	3,53
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,70	2,71	2,72	2,73	4,32
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,81	2,81	2,81	2,81	5,31
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,81	2,81	2,81	2,81	2,81
Indice canadien BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,67	18,73	15,39	14,97	12,52
Valeur liquidative par part, Classe B	16,09	18,08	14,86	14,46	12,09
Valeur liquidative par part, Classe D	16,27	18,28	15,02	14,61	12,22
Valeur liquidative par part, Classe E	16,94	19,04	15,64	15,22	12,73
Valeur liquidative par part, Classe F	16,55	18,59	15,27	14,85	12,42
Valeur liquidative par part, Classe G	16,11	18,11	14,87	14,47	12,10
Valeur liquidative par part, Classe H	15,65	17,59	14,45	14,06	11,76
Valeur liquidative par part, Classe I	20,33	22,54	18,02	17,05	13,88
Valeur liquidative par part, Classe J	20,44	22,66	18,11	17,14	13,95
Valeur liquidative par part, Classe N	16,93	19,02	15,63	15,21	12,72
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	12 739	12 977	13 862	15 766	18 900
Nombre de parts en circulation**	761 713	698 875	897 432	1 045 819	1 469 191
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,76	2,76	2,77	2,76	3,26
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,76	2,76	2,76	2,76	4,38
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,76	2,76	2,77	2,76	4,04
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,76	2,76	2,76	2,75	2,75
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,72	2,71	2,72	2,73	3,53
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,75	2,76	2,75	2,74	4,35
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,76	2,76	2,76	2,76	5,26
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,01	0,01	0,01	-	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,01	0,01	0,01	-	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,76	2,76	2,77	2,76	2,77

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	21,56	27,15	22,19	19,11	15,34
Valeur liquidative par part, Classe B	20,60	25,94	21,20	18,26	14,66
Valeur liquidative par part, Classe E	21,94	27,62	22,58	19,44	15,60
Valeur liquidative par part, Classe F	21,39	26,93	22,00	18,93	15,18
Valeur liquidative par part, Classe G	20,82	26,22	21,42	18,44	14,80
Valeur liquidative par part, Classe I	26,81	33,25	26,37	22,03	17,15
Valeur liquidative par part, Classe J	26,81	33,25	26,37	22,03	17,15
Valeur liquidative par part, Classe N	21,90	27,58	22,54	19,41	15,58
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	21 218	27 164	19 651	17 647	16 593
Nombre de parts en circulation**	957 551	973 095	865 859	909 819	1 073 337
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,10	3,09	3,10	3,11	3,61
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,09	3,08	3,10	3,11	5,06
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,09	3,07	3,08	3,09	3,08
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,02	3,01	3,03	3,03	3,94
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,06	3,05	3,06	3,07	4,78
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,06	0,04	0,06	0,07	0,07
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,06	0,04	0,06	0,07	0,07
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,10	3,09	3,10	3,12	3,12
Actions américaines Hillsdale					
Valeur liquidative par part, Classe A	32,94	39,98	30,36	29,05	25,35
Valeur liquidative par part, Classe B	31,81	38,61	29,31	28,05	24,48
Valeur liquidative par part, Classe E	33,50	40,66	30,87	29,52	25,76
Valeur liquidative par part, Classe F	32,73	39,72	30,14	28,81	25,13
Valeur liquidative par part, Classe G	31,92	38,74	29,41	28,13	24,55
Valeur liquidative par part, Classe I	41,12	49,15	36,18	33,56	28,39
Valeur liquidative par part, Classe J	40,61	48,54	35,73	33,14	28,04
Valeur liquidative par part, Classe K	46,57	55,67	40,98	38,00	32,15
Valeur liquidative par part, Classe L	13,94	16,67	12,27	11,38	9,63
Valeur liquidative par part, Classe N	33,04	40,11	30,45	29,13	25,43
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	70 896	92 873	82 026	84 684	74 557
Nombre de parts en circulation**	1 800 961	1 966 121	2 303 539	2 547 531	2 549 573
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,12	3,13	3,11	3,14	3,65
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,12	3,13	3,11	3,14	4,77
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,11	3,11	3,07	3,13	3,14
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,07	3,07	3,04	3,09	3,91
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,10	3,11	3,09	3,13	4,66
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	-	0,04	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	-	0,04	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,02	0,02	-	0,04	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,02	-	0,04	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,12	3,13	3,11	3,14	3,15

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions américaines Beutel Goodman					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,07	17,31	15,63	14,74	12,26
Valeur liquidative par part, Classe B	15,52	16,71	15,09	14,23	11,84
Valeur liquidative par part, Classe E	16,35	17,61	15,89	14,98	12,46
Valeur liquidative par part, Classe F	15,98	17,20	15,52	14,63	12,16
Valeur liquidative par part, Classe G	15,57	16,77	15,13	14,27	11,87
Valeur liquidative par part, Classe I	19,91	21,12	18,51	16,95	13,68
Valeur liquidative par part, Classe J	19,91	21,12	18,51	16,95	13,68
Valeur liquidative par part, Classe N	16,33	17,58	15,87	14,97	12,46
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	40 062	34 040	29 808	37 219	37 839
Nombre de parts en circulation**	2 440 073	1 941 573	1 903 910	2 524 064	3 085 131
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,06	3,06	3,06	3,06	3,55
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,06	3,06	3,06	3,06	4,67
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,04	3,03	3,02	3,03	3,04
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,01	3,00	2,98	2,98	3,78
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,03	3,02	3,03	3,03	4,58
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,07	0,07	0,07	0,07	0,07
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,06	3,06	3,06	3,06	3,06
Actions américaines Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	19,49	24,09	18,66	16,07	12,92
Valeur liquidative par part, Classe B	18,84	23,27	18,04	15,53	12,48
Valeur liquidative par part, Classe D	18,98	23,45	18,18	15,66	12,58
Valeur liquidative par part, Classe E	19,81	24,48	18,97	16,33	13,13
Valeur liquidative par part, Classe F	19,38	23,93	18,53	15,95	12,81
Valeur liquidative par part, Classe G	18,88	23,33	18,08	15,57	12,51
Valeur liquidative par part, Classe H	18,30	22,61	17,52	15,09	12,13
Valeur liquidative par part, Classe I	24,04	29,28	22,04	18,43	14,39
Valeur liquidative par part, Classe J	24,05	29,29	22,05	18,44	14,39
Valeur liquidative par part, Classe N	19,80	24,46	18,96	16,33	13,12
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	109 731	154 091	104 261	78 095	56 895
Nombre de parts en circulation**	5 564 520	6 335 209	5 560 125	4 831 046	4 408 384
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,97	2,96	2,97	2,98	3,48
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,97	2,96	2,97	2,98	4,56
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,97	2,97	2,98	2,99	4,30
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,93	2,94	2,96	2,98	2,97
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,89	2,89	2,92	2,94	3,75
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,95	2,95	2,96	2,97	4,51
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,97	2,96	2,97	2,98	5,48
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,04	0,05	0,06	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,04	0,05	0,06	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,96	2,96	2,97	2,98	2,98

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	18,37	23,30	17,96	15,30	11,79
Valeur liquidative par part, Classe B	17,92	22,74	17,53	14,93	11,51
Valeur liquidative par part, Classe E	18,59	23,57	18,16	15,47	11,92
Valeur liquidative par part, Classe F	18,29	23,20	17,86	15,21	11,72
Valeur liquidative par part, Classe G	18,06	22,90	17,64	15,01	11,55
Valeur liquidative par part, Classe I	21,93	27,41	20,51	16,96	12,69
Valeur liquidative par part, Classe J	21,93	27,41	20,51	16,96	12,69
Valeur liquidative par part, Classe N	18,54	23,52	18,13	15,45	11,91
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	23 206	31 253	23 931	14 489	9 421
Nombre de parts en circulation**	1 234 212	1 310 555	1 288 708	933 316	787 479
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,02	3,02	3,03	3,05	3,53
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,05	3,05	3,06	3,07	4,68
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,01	3,00	3,01	3,02	3,00
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,94	2,94	2,97	3,01	3,82
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,97	2,98	2,91	2,89	4,41
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,06	0,06	0,07	0,08	0,08
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,06	0,06	0,07	0,08	0,08
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,05	3,05	3,06	3,07	3,07
Indice américain BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe A	19,19	23,84	19,27	17,14	14,17
Valeur liquidative par part, Classe B	18,53	23,02	18,60	16,54	13,68
Valeur liquidative par part, Classe D	18,70	23,24	18,77	16,70	13,81
Valeur liquidative par part, Classe E	19,55	24,28	19,61	17,44	14,41
Valeur liquidative par part, Classe F	19,14	23,77	19,19	17,05	14,08
Valeur liquidative par part, Classe G	18,63	23,14	18,69	16,62	13,73
Valeur liquidative par part, Classe H	18,02	22,39	18,09	16,09	13,30
Valeur liquidative par part, Classe I	23,60	28,90	22,69	19,61	15,76
Valeur liquidative par part, Classe J	23,87	29,23	22,95	19,84	15,94
Valeur liquidative par part, Classe N	19,50	24,22	19,57	17,41	14,39
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	47 411	72 019	57 240	53 821	47 944
Nombre de parts en circulation**	2 382 122	2 928 202	2 909 302	3 093 584	3 351 429
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,88	2,88	2,88	2,88	3,38
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,87	2,87	2,88	2,88	4,50
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,88	2,87	2,88	2,88	4,20
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,84	2,84	2,84	2,84	2,84
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,77	2,78	2,78	2,77	3,56
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,84	2,85	2,83	2,83	4,37
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,87	2,87	2,88	2,88	5,38
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	0,01	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	0,01	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,88	2,88	2,88	2,89	2,88

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher					
Valeur liquidative par part, Classe A	7,42	10,60	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	7,42	10,60	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	7,42	10,60	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	7,42	10,60	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	7,42	10,60	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	7,68	10,79	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	7,90	11,09	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	7,42	10,60	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	8 796	11 674	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 121 991	1 055 031	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,53	3,54	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,53	3,51	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,53	3,54	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,53	3,53	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,53	3,51	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,14	0,15	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,14	0,15	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,53	3,51	-	-	-
Actions internationales GQG Partners					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,09	10,27	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	9,09	10,27	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	9,09	10,27	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	9,09	10,27	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	9,09	10,27	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	9,42	10,46	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,23	11,36	10,06	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	9,09	10,27	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	32 431	24 604	14 363	-	-
Nombre de parts en circulation**	3 291 214	2 183 000	1 427 333	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,45	3,44	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,44	3,42	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,42	3,45	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,44	3,44	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,45	3,42	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,45	3,45	-	-	-
Actions internationales C WorldWide					
Valeur liquidative par part, Classe A	15,33	19,72	18,67	15,59	13,26
Valeur liquidative par part, Classe B	14,73	18,96	17,94	14,99	12,75
Valeur liquidative par part, Classe D	8,55	11,01	10,42	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	15,59	20,06	18,98	15,86	13,48

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions internationales C WorldWide (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe F	15,20	19,56	18,50	15,45	13,14
Valeur liquidative par part, Classe G	14,84	19,09	18,06	15,08	12,81
Valeur liquidative par part, Classe H	8,55	11,01	10,42	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	19,48	24,65	22,56	18,22	14,99
Valeur liquidative par part, Classe J	19,48	24,65	22,56	18,22	14,99
Valeur liquidative par part, Classe K	19,48	24,65	22,56	18,22	14,99
Valeur liquidative par part, Classe L	12,94	16,37	14,98	12,10	9,95
Valeur liquidative par part, Classe N	15,55	20,01	18,94	15,83	13,47
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	193 623	231 106	197 193	164 715	136 718
Nombre de parts en circulation**	10 300 617	9 724 805	9 039 565	9 232 948	9 293 910
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,38	3,36	3,37	3,37	3,87
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,38	3,37	3,38	3,38	5,12
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,39	3,39	3,39	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,36	3,36	3,36	3,36	3,34
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,32	3,34	3,34	3,34	4,20
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,32	3,34	3,29	3,30	4,95
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,38	3,38	3,38	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,39	3,39	3,39	3,39	3,39
Indice international BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe A	12,33	15,21	14,22	13,84	12,31
Valeur liquidative par part, Classe B	11,86	14,63	13,68	13,31	11,84
Valeur liquidative par part, Classe D	11,97	14,77	13,81	13,44	11,95
Valeur liquidative par part, Classe E	12,55	15,48	14,46	14,07	12,51
Valeur liquidative par part, Classe F	12,21	15,07	14,08	13,70	12,18
Valeur liquidative par part, Classe G	11,90	14,68	13,72	13,35	11,87
Valeur liquidative par part, Classe H	11,56	14,26	13,33	12,98	11,54
Valeur liquidative par part, Classe I	15,45	18,76	16,99	16,03	13,81
Valeur liquidative par part, Classe J	15,45	18,76	16,99	16,03	13,81
Valeur liquidative par part, Classe N	12,52	15,45	14,44	14,06	12,50
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	10 742	19 289	88 262	63 335	57 525
Nombre de parts en circulation**	798 029	1 120 789	5 307 161	4 057 826	4 261 945
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,17	3,18	3,17	3,18	3,67
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,17	3,17	3,17	3,17	4,91
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,17	3,18	3,18	3,18	4,60
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,14	3,14	3,13	3,14	3,16
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,14	3,16	3,16	3,16	4,01
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,15	3,15	3,15	3,15	4,82
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,18	3,18	3,18	3,18	5,72

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Indice international BlackRock (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,01	0,02	0,02	0,02	0,02
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,01	0,02	0,02	0,02	0,02
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,18	3,18	3,18	3,18	3,18
Actions mondiales dividendes TD					
Valeur liquidative par part, Classe A	14,12	15,30	13,45	14,28	12,76
Valeur liquidative par part, Classe B	13,54	14,66	12,87	13,65	12,19
Valeur liquidative par part, Classe E	14,37	15,56	13,68	14,52	12,96
Valeur liquidative par part, Classe F	14,09	15,25	13,40	14,20	12,67
Valeur liquidative par part, Classe G	13,68	14,82	13,02	13,82	12,34
Valeur liquidative par part, Classe I	17,83	19,00	16,17	16,61	14,36
Valeur liquidative par part, Classe J	17,83	19,00	16,17	16,61	14,36
Valeur liquidative par part, Classe L	14,54	15,49	13,18	13,55	11,71
Valeur liquidative par part, Classe N	14,34	15,53	13,66	14,50	12,95
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	22 257	29 464	26 358	35 668	32 100
Nombre de parts en circulation**	1 550 245	1 812 062	1 884 604	2 388 528	2 446 029
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,32	3,30	3,29	3,30	3,79
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,18	3,17	3,20	3,21	5,21
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,28	3,27	3,26	3,27	3,26
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,17	3,17	3,18	3,19	3,99
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,27	3,25	3,24	3,24	4,85
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,02	0,02	0,02	0,02
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,02	0,02	0,02	0,02
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,04	0,02	0,02	0,02	0,02
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,32	3,30	3,30	3,30	3,30
Actions mondiales Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,88	21,57	17,74	15,54	12,60
Valeur liquidative par part, Classe B	16,32	20,85	17,14	15,01	12,17
Valeur liquidative par part, Classe D	9,84	12,57	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	17,12	21,87	17,99	15,75	12,78
Valeur liquidative par part, Classe F	16,86	21,54	17,69	15,48	12,55
Valeur liquidative par part, Classe G	16,47	21,04	17,30	15,14	12,27
Valeur liquidative par part, Classe H	9,84	12,57	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	21,20	26,61	21,12	17,86	13,98
Valeur liquidative par part, Classe J	21,28	26,71	21,20	17,92	14,03
Valeur liquidative par part, Classe L	14,89	18,70	14,84	12,54	9,82
Valeur liquidative par part, Classe N	17,11	21,86	17,98	15,75	12,78
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	197 550	283 542	205 378	177 181	85 828
Nombre de parts en circulation**	10 202 541	11 543 956	10 385 300	10 220 549	6 310 012
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,61	3,60	3,60	3,60	4,10
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,59	3,54	3,58	3,58	5,48
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,61	3,61	3,61	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,59	3,59	3,59	3,58	3,59

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions mondiales Fiera Capital (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,48	3,49	3,50	3,50	4,32
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,54	3,54	3,54	3,52	5,15
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,61	3,61	3,61	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,04	0,05	0,04	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,04	0,05	0,04	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,05	0,04	0,05	0,04	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,60	3,60	3,60	3,59	3,58
Actions mondiales GQG Partners					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,20	10,68	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,20	10,68	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,20	10,68	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,21	10,68	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,20	10,68	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,58	10,88	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,86	11,17	9,59	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,24	10,72	9,53	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	18 547	7 580	6 670	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 726 493	685 770	695 857	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,51	3,47	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,49	3,47	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,47	3,51	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,29	3,51	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,50	3,47	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,51	3,48	3,45	-	-
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,48	15,21	13,51	10,83	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,48	15,21	13,51	10,83	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,49	15,23	13,52	10,83	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,50	15,24	13,53	10,83	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,49	15,22	13,52	10,83	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,62	16,58	14,24	11,03	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,62	16,58	14,24	11,03	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,48	15,21	13,51	10,83	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	94 530	115 459	90 858	71 691	-
Nombre de parts en circulation**	8 271 456	7 084 898	6 440 611	6 518 954	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,43	3,43	3,45	3,49	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,39	3,43	3,45	3,49	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,41	3,39	3,41	3,45	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,35	3,36	3,38	3,43	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,40	3,40	3,43	3,46	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,04	0,06	0,10	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,04	0,06	0,10	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,43	3,43	3,45	3,49	-
Actions marchés émergents Fisher					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,73	13,95	16,32	13,29	11,93
Valeur liquidative par part, Classe B	10,11	13,14	15,38	12,52	11,24
Valeur liquidative par part, Classe E	10,93	14,20	16,61	13,52	12,14
Valeur liquidative par part, Classe F	10,67	13,85	16,18	13,16	11,80
Valeur liquidative par part, Classe G	10,36	13,46	15,75	12,81	11,50
Valeur liquidative par part, Classe I	14,13	18,01	20,26	15,86	13,70
Valeur liquidative par part, Classe J	13,94	17,77	20,00	15,66	13,52
Valeur liquidative par part, Classe L	10,04	12,80	14,41	11,28	9,74
Valeur liquidative par part, Classe N	10,75	13,97	16,35	13,31	11,95
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	81 932	86 281	99 724	78 688	111 671
Nombre de parts en circulation**	6 053 861	5 024 907	5 108 783	5 103 804	8 338 227
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,04	4,01	3,94	3,91	4,38
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,04	4,01	3,94	3,91	6,30
Ratio des frais de gestion, Classe E	4,01	3,99	3,91	3,89	3,86
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,83	3,85	3,82	3,80	4,78
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,94	3,96	3,88	3,86	5,58
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,13	0,11	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,13	0,11	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,13	0,11	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	4,04	4,02	3,94	3,91	3,91
Infrastructures mondiales Lazard					
Valeur liquidative par part, Classe A	17,71	18,10	15,53	17,03	14,29
Valeur liquidative par part, Classe B	17,32	17,69	15,15	16,60	13,91
Valeur liquidative par part, Classe E	18,05	18,44	15,81	17,33	14,54
Valeur liquidative par part, Classe F	17,60	17,97	15,39	16,86	14,13
Valeur liquidative par part, Classe I	22,63	22,74	18,84	19,97	16,19
Valeur liquidative par part, Classe J	22,62	22,73	18,83	19,96	16,18
Valeur liquidative par part, Classe L	13,53	13,60	11,27	11,94	9,68
Valeur liquidative par part, Classe N	17,99	18,38	15,77	17,30	14,52
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	98 655	119 220	80 083	96 740	106 217
Nombre de parts en circulation**	4 871 213	5 681 435	4 659 913	5 189 680	6 762 945
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,48	3,49	3,49	3,50	3,98
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,37	3,34	3,34	3,37	4,83
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,44	3,45	3,43	3,44	3,44
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,31	3,34	3,34	3,36	4,35
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,05	0,06	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,05	0,06	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,04	0,05	0,05	0,06	0,04

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2022 (en milliers de dollars)

	2022	2021	2020	2019	2018
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ					
Infrastructures mondiales Lazard (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,49	3,49	3,49	3,50	3,49
Immobilier mondial CI					
Valeur liquidative par part, Classe A	8,89	11,34	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	8,89	11,34	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	8,89	11,34	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	8,90	11,35	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	9,22	11,56	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	9,22	11,56	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	9,22	11,56	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	8,89	11,34	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	9 947	6 759	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 096 291	592 729	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,55	3,56	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,54	3,54	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,50	3,49	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,39	3,41	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,56	3,56	-	-	-

**Nombre de parts total du Fonds

Bureau des ventes – Québec

Tél. : 1 888 292-8483

**Bureau des ventes – Ontario
Ouest du Canada et Maritimes**

Tél. : 1 888 429-2543

Service à la clientèle

2515, boulevard Laurier
C.P. 10510, succ. Sainte-Foy
Québec (Québec) G1V 0A3

Tél. : 1 800 320-4887
Télééc. : 1 866 559-6871

service.inv@ssq.ca

ssq.ca

