

FONDS SSQ

États financiers intermédiaires (non audités)
30 juin 2017

SSQ Groupe
financier

Les valeurs à la bonne place



Investissement

Table des matières

	Page
Fonds SSQ Marché monétaire Fiera Capital	3
Fonds SSQ Trésorerie OGP	8
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital	15
Fonds SSQ Obligations OGP	20
Fonds SSQ Obligations PIMCO	25
Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO	30
Fonds SSQ Obligations de sociétés CI Signature	35
Fonds SSQ Indice obligataire BlackRock	40
Fonds SSQ Stratégie sécuritaire	45
Fonds SSQ Stratégie équilibrée	50
Fonds SSQ Stratégie croissance	55
Fonds SSQ Stratégie audacieuse	60
Fonds SSQ Celestia sécuritaire	65
Fonds SSQ Celestia équilibré	70
Fonds SSQ Celestia croissance	75
Fonds SSQ Celestia audacieux	80
Fonds SSQ Portefeuille fondamental sécuritaire BlackRock	86
Fonds SSQ Portefeuille fondamental équilibré BlackRock	91
Fonds SSQ Portefeuille fondamental croissance BlackRock	96
Fonds SSQ Portefeuille fondamental audacieux BlackRock	101
Fonds SSQ Équilibré Power Dynamique	107
Fonds SSQ Revenu mensuel sécuritaire Guardian	112
Fonds SSQ Revenu mensuel Guardian	117
Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge	122
Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI Signature	127
Fonds SSQ Actions canadiennes dividendes Guardian	132
Fonds SSQ Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée	137
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima	142
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton	148
Fonds SSQ Indice canadien BlackRock	154
Fonds SSQ Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital	159
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale	164
Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman	171
Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital	176
Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	181
Fonds SSQ Indice américain BlackRock	186
Fonds SSQ Actions internationales Hexavest	191
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide	196
Fonds SSQ Indice international BlackRock	202
Fonds SSQ Actions mondiales Calamos	207
Fonds SSQ Actions mondiales dividendes TD	215
Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital	220
Fonds SSQ Actions mondiales couvertes sur les devises Hexavest	225
Fonds SSQ Actions mondiales tous pays Hexavest	230
Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Lazard	235
Fonds SSQ Actions marchés émergents Fisher	240
Fonds SSQ Infrastructures mondiales Lazard	245
Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley	250
Notes complémentaires aux états financiers	255
Annexe – informations financières	286

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	8 067	8 452
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	7	6
Total de l'actif	8 074	8 458
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	1	41
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	1	1
Total du passif	2	42
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	8 072	8 416
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	2017	2016
	\$	\$
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	44	28
Distributions par le fonds sous-jacent	35	32
	79	60
Charges		
Frais de gestion (note 6)	72	44
Frais d'administration	5	3
Frais de transactions	-	-
	77	47
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2	13
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	0,04	0,03
Classe J	0,04	0,03
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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	8 416	12 994
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 903	11 232
Parts rachetées	(9 247)	(12 860)
	(344)	(1 628)
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(2)	(13)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2	13
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	8 072	11 366

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2	13
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	(35)	(32)
	(33)	(19)
Transactions de placements		
Acquisitions	(6 145)	(9 030)
Cessions	6 565	10 825
	420	1 795
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1)	(17)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	386	1 759
Financement		
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(2)	(13)
Parts émises	8 903	11 232
Parts rachetées	(9 247)	(12 860)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(346)	(1 641)
Variation nette de la trésorerie	40	118
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(41)	39
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(1)	157
Intérêts reçus	44	28
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,94 %)			
Fonds Fiera de gestion active d'encaisse	806 660	8 067	8 067
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,06 %)			5
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			8 072

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera de gestion active d'encaisse</i>	%
Gouvernement du Canada, 0,50 %, 01-08-2018	13,10
Province de Québec, Bon du Trésor, 0,76 %, 15-09-2017	2,58
Province de l'Alberta, Bon du Trésor, 0,91 %, 04-04-2018	2,57
Banque de Nouvelle-Écosse, Billet, 0,96 %, 25-08-2017	2,45
CIBC, Billet, 0,97 %, 02-02-2018	2,18
Province du Nouveau-Brunswick, Bon du Trésor, 0,69 %, 10-08-2017	2,18
Province de la Colombie-Britannique, Bon du Trésor, 0,80 %, 29-11-2017	2,17
Banque Toronto-Dominion, Billet, 1,22 %, 04-07-2017	2,10
Province du Manitoba, Bon du Trésor, 0,64 %, 26-07-2017	2,07
Nestlé Capital Canada Ltd., Billet, 1,02 %, 29-08-2017	1,95

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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. 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	8 067	-	-	8 067
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	8 067	-	-	8 067

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	8 452	-	-	8 452
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	8 452	-	-	8 452

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ TRÉSORERIE OGP

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	62 278	68 659
Trésorerie	451	-
Cession de placements à recevoir	-	403
Autres débiteurs	339	377
Total de l'actif	63 068	69 439
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	128
Achat de placements à payer	197	-
Autres créditeurs	8	9
Total du passif	205	137
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	62 863	69 302
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,89	10,89
Classe B	10,74	10,78
Classe C	10,89	10,89
Classe E	10,89	10,89
Classe F	10,90	10,90
Classe G	10,87	10,88
Classe I	11,27	11,15
Classe J	11,27	11,15
Classe K	11,27	11,15
Classe N	10,89	10,89

FONDS SSQ TRÉSORERIE OGP

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(156)	(17)
Non réalisé(e) sur les placements	25	188
Total gain net (perte nette)	(131)	171
Intérêts aux fins d'attribution	840	854
Prêts de titres	2	-
	711	1 025
Charges		
Frais de gestion (note 6)	154	199
Frais d'administration	8	9
Frais de transactions	-	-
	162	208
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	549	817
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,01	0,06
Classe B	(0,04)	0,01
Classe C	0,01	0,06
Classe E	0,01	0,06
Classe F	0,01	0,06
Classe G	-	0,05
Classe I	0,12	0,17
Classe J	0,12	0,17
Classe K	0,12	0,17
Classe N	0,01	0,06

FONDS SSQ TRÉSORERIE OGP

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	69 302	66 190
Opérations sur les parts		
Parts émises	16 338	17 918
Parts rachetées	(23 326)	(16 404)
	(6 988)	1 514
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	549	817
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	62 863	68 521

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	549	817
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	131	(171)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	680	646
Transactions de placements		
Acquisitions	(23 767)	(15 984)
Cessions	30 017	13 114
	6 250	(2 870)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	637	(1 936)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	7 567	(4 160)
Financement		
Parts émises	16 338	17 918
Parts rachetées	(23 326)	(16 404)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(6 988)	1 514
Variation nette de la trésorerie	579	(2 646)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(128)	2 190
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	451	(456)
Intérêts reçus	880	813
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ TRÉSORERIE OGP

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers)

	Valeur nominale	Coût moyen	Juste valeur		Valeur nominale	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
OBLIGATIONS CANADIENNES (99,07 %)				OBLIGATIONS CANADIENNES (99,07 %) (suite)			
Gouvernement du Canada (11,02 %)				Municipalités et octroyées (50,09 %) (suite)			
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 0,85 %, 15-09-2019	495	496	496	La Tuque, 2,40 %, 30-09-2019	250	247	253
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 1,25 %, 15-12-2020	670	669	664	Lac-Brome, 2,25 %, 03-07-2018	200	196	201
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 2,90 %, 15-06-2024	1 968	2 127	2 083	Lachute, 2,40 %, 13-05-2019	100	101	101
Fiducie canadienne pour l'habitation No 2, 1,50 %, 15-12-2021	3 719	3 708	3 685	Lévis, 1,85 %, 08-09-2019	300	296	300
		<u>7 000</u>	<u>6 928</u>	Lévis, 2,75 %, 05-09-2018	100	102	101
				Lévis, 4,10 %, 03-02-2021	240	262	256
				Longueuil, 2,65 %, 20-11-2018	29	30	29
				Longueuil, 4,75 %, 08-07-2019	50	55	53
				Magog, 2,25 %, 03-07-2018	390	383	393
				Mascouche, 1,35 %, 20-07-2018	200	199	199
				Mirabel, 2,70 %, 20-11-2018	245	241	248
				Notre-Dame-de-l'Île-Perrot, 2,75 %, 27-11-2018	50	51	51
				Percé, 2,35 %, 31-07-2018	496	492	499
				Pointe-Claire, 1,45 %, 23-09-2017	103	102	103
				Port-Cartier, 2,10 %, 01-02-2022	1 000	985	988
				Rawdon, 2,25 %, 03-07-2018	650	627	654
				Rawdon, 2,75 %, 27-11-2018	450	446	457
				Réseau de transport de Longueuil, 2,60 %, 18-12-2018	600	591	608
				Rivière-du-Loup, 1,75 %, 29-06-2021	245	242	241
				Rosemère, 1,25 %, 07-09-2017	362	361	362
				Saguenay, 2,35 %, 21-10-2019	350	345	354
				Saguenay, 3,25 %, 21-10-2024	250	251	259
				Saint-Amable, 1,80 %, 16-11-2021	300	296	293
				Saint-Augustin-de-Desmaures, 1,95 %, 10-02-2020	172	171	172
				Saint-Bruno-de-Montarville, 3,15 %, 09-09-2024	600	599	616
				Saint-Eustache, 2,00 %, 30-09-2019	156	157	156
				Saint-Georges, 2,50 %, 26-02-2019	413	406	418
				Saint-Jean-sur-Richelieu, 1,60 %, 23-06-2018	111	110	111
				Saint-Jean-sur-Richelieu, 2,25 %, 19-06-2018	500	493	503
				Saint-Jérôme, 4,40 %, 09-12-2019	278	300	294
				Saint-Lin-Laurentides, 2,50 %, 27-08-2018	500	493	504
				Saint-Thomas, 1,50 %, 22-03-2018	280	278	280
				Saint-Tite, 2,40 %, 15-10-2019	258	262	260
				Sainte-Agathe, 2,40 %, 01-11-2017	380	374	381
				Sainte-Brigitte-de-Laval, 2,35 %, 28-05-2019	500	493	505
				Sainte-Julie, 2,10 %, 22-05-2018	520	523	522
				Sainte-Sophie, 1,35 %, 15-11-2018	246	245	245
				Sainte-Thérèse, 2,10 %, 22-05-2018	231	227	232
				Salaberry-de-Valleyfield, 1,45 %, 02-11-2019	60	60	59
				Shawinigan, 1,85 %, 15-10-2017	500	496	501
				Shawinigan, 3,40 %, 16-05-2022	200	212	209
				Sherbrooke, 2,85 %, 23-10-2018	1 572	1 609	1 593
				Société de transport de l'Outaouais, 1,65 %, 13-04-2021	230	227	226
				Société de transport de l'Outaouais, 2,20 %, 10-04-2018	120	121	121
				Société de transport de Laval, 1,90 %, 21-10-2017	500	497	501
				Terrebonne, 2,30 %, 19-11-2019	157	159	158
				Trois-Pistoles, 1,45 %, 22-11-2019	135	134	133
				Trois-Rivières, 4,40 %, 08-10-2019	379	406	400
				Val-d'Or, 1,90 %, 01-09-2021	700	690	692
				Val-d'Or, 2,25 %, 19-03-2018	350	346	352
				Varenes, 2,05 %, 28-03-2022	500	496	493
				Victoriaville, 2,45 %, 19-02-2019	535	525	541
				Westmount, 2,35 %, 20-02-2018	473	467	476
						<u>31 223</u>	<u>31 486</u>

* Taux flottant; le taux indiqué est le taux d'intérêt effectif au 30 juin 2017.

FONDS SSQ TRÉSORERIE OGP

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers)

	Valeur nominale	Coût moyen	Juste valeur		Valeur nominale	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
OBLIGATIONS CANADIENNES (99,07 %) (suite)				OBLIGATIONS CANADIENNES (99,07 %) (suite)			
Sociétés (27,01 %)				Sociétés (27,01 %) (suite)			
AltaLink LP, 3,67 %, 06-11-2023	233	262	252	La Compagnie d'Assurance-Vie Manufacturers, 2,93 %, 29-11-2023	750	752	761
AON Finance NS, 4,76 %, 08-03-2018	340	342	347	Lower Mattagami Energy LP, 2,31 %, 21-10-2026	290	290	284
Autorité aéroportuaire du Grand Toronto, 6,45 %, 03-12-2027	105	148	141	Metro Inc., 1,46 %*, 27-02-2020	805	805	807
Banque de Montréal, 1,17 %*, 07-05-2018	580	580	582	OMERS Realty Corp., 3,36 %, 05-06-2023	220	222	233
Banque de Nouvelle-Écosse, 2,09 %, 09-09-2020	300	300	302	Société de services financiers Wells Fargo Canada, 3,46 %, 24-01-2023	300	327	317
Banque de Nouvelle-Écosse, 2,90 %, 03-08-2022	270	272	271	Suncor Energy Inc., 5,80 %, 22-05-2018	100	107	104
Banque de Nouvelle-Écosse, 3,04 %, 18-10-2024	355	356	363	TMX Group Ltd., 4,46 %, 03-10-2023	318	353	346
Banque Laurentienne du Canada, 1,77 %*, 27-06-2019	90	90	90	Toyota Credit Canada Inc., 1,80 %, 19-02-2020	210	212	210
Banque Laurentienne du Canada, 2,50 %, 23-01-2020	720	720	723	Vancouver International Airport Authority, 7,43 %, 07-12-2026	75	109	106
Banque Laurentienne du Canada, 2,56 %, 26-03-2018	63	64	63		<u>17 043</u>	<u>16 977</u>	
Banque Laurentienne du Canada, 2,75 %, 22-04-2021	830	834	836	TOTAL OBLIGATIONS CANADIENNES	<u>62 279</u>	<u>62 278</u>	
Banque Laurentienne du Canada, 2,81 %, 13-06-2019	335	337	340				
Banque Nationale du Canada, 1,74 %, 03-03-2020	345	345	344	TOTAL DES PLACEMENTS (99,07 %)	<u>62 279</u>	<u>62 278</u>	
Banque Nationale du Canada, 1,81 %, 26-07-2021	370	370	367	AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,93 %)			<u>585</u>
Banque Nationale du Canada, 1,96 %, 30-06-2022	250	250	247	TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>62 863</u>
Banque Nationale du Canada, 2,40 %, 28-10-2019	65	67	66				
Banque Royale du Canada, 2,35 %, 09-12-2019	380	384	386				
Banque Toronto-Dominion, 1,99 %, 23-03-2022	255	255	254				
Banque Toronto-Dominion, 2,56 %, 24-06-2020	65	67	66				
bclMC Realty Corp., 2,15 %, 11-08-2022	250	250	248				
Bell Canada, 3,15 %, 29-09-2021	340	351	352				
Brookfield Asset Management Inc., 3,95 %, 09-04-2019	557	569	577				
Brookfield Asset Management Inc., 5,04 %, 08-03-2024	50	57	56				
Caisse centrale Desjardins du Québec, 1,75 %, 02-03-2020	300	299	299				
Canadian Western Bank, 2,38 %, 23-01-2020	500	500	499				
Capital Desjardins Inc., 5,19 %, 05-05-2020	700	780	760				
Central 1 Credit Union, 1,51 %*, 21-11-2018	365	365	366				
Central 1 Credit Union, 2,89 %, 25-04-2024	668	668	670				
Central 1 Credit Union, 3,06 %, 14-10-2026	525	525	521				
CIBC, 1,64 %, 12-07-2021	329	329	324				
CIBC, 1,70 %, 09-10-2018	236	236	237				
CIBC, 2,35 %, 18-10-2017	304	312	305				
CIBC, 6,00 %, 06-06-2023	170	194	177				
Compagnie d'assurance Standard Life du Canada, 3,94 %, 21-09-2022	357	364	359				
Dollarama Inc., 1,50 %*, 16-03-2020	175	175	175				
Financière Sun Life Inc., 4,57 %, 23-08-2021	100	112	110				
Honda Canada Finance Inc., 2,28 %, 11-12-2017	325	329	327				
Intact Corporation financière, 4,70 %, 18-08-2021	500	560	550				
Inter Pipeline Ltd., 3,17 %, 24-03-2025	200	200	201				
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, 2,87 %, 31-05-2023	517	513	519				
L'Empire, Compagnie d'Assurance-Vie, 3,38 %, 16-12-2026	135	135	137				

* Taux flottant; le taux indiqué est le taux d'intérêt effectif au 30 juin 2017.

FONDS SSQ TRÉSORERIE OGP

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Objectif du Fonds

Le Fonds SSQ Trésorerie OGP (ci-après « Fonds ») a pour objectif de générer un revenu régulier et une croissance modérée du capital à court et à moyen terme.

Stratégie de placement

Le Fonds est investi principalement dans des titres à revenu fixe canadiens. Ces titres sont émis par le gouvernement fédéral, les gouvernements provinciaux, les municipalités ainsi que des sociétés canadiennes. Le Fonds peut détenir des parts de fonds correspondant aux titres précités.

La stratégie d'investissement du gestionnaire externe, Optimum Gestion de Placements, 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.

Au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, l'actif du Fonds est composé principalement de titres obligataires canadiens négociables sur un marché actif.

Risques présents

Le Fonds est exposé principalement au risque de crédit, au risque de taux d'intérêt, au risque du marché obligataire 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

L'exposition du Fonds au risque de crédit découle des placements dans des titres à revenu fixe. La politique du Fonds en matière de gestion du risque de crédit consiste à investir dans des titres du marché monétaire qui doivent détenir une cote de crédit égale ou supérieure à R-1 selon *Dominion Bond Rating Service (DBRS)* et des titres obligataires qui doivent détenir une cote de crédit égale ou supérieure à BBB selon *Standard & Poor's*. Les titres obligataires cotés BBB ne doivent pas représenter plus de 10 % de l'actif du Fonds.

Le tableau suivant présente la répartition des titres à revenu fixe détenus par le Fonds selon les cotes de crédit :

Cotes de crédit*	30 juin 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Municipalités et octroyées	49,76	49,86
Cotés AAA	11,12	13,73
Cotés AA	16,44	12,58
Cotés A	20,22	18,53
Cotés BBB	2,46	5,30

* Sources : DBRS et Standard & Poor's

Risque de crédit (suite)

Toutes les transactions de titres négociables sont réglées ou payées à la livraison par l'intermédiaire de courtiers agréés. La livraison des titres vendus n'est exécutée que lorsque le courtier a reçu le paiement. Le paiement des achats n'est effectué que lorsque les titres ont été reçus par le courtier. La transaction échoue si l'une des parties ne remplit pas ses obligations.

Le Fonds peut participer à des opérations de prêts de titres. Au 30 juin 2017, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 9 225 \$ (3 905 \$ au 31 décembre 2016) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 9 708 \$ (4 101 \$ au 31 décembre 2016).

De plus, au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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. 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.

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

30 juin 2017	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	197	-	197
Autre créditeurs	8	-	8

31 décembre 2016	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres créditeurs	9	-	9

Risque de taux d'intérêt

Le tableau suivant présente les échéances contractuelles des placements à leur juste valeur afin de refléter l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt :

Placements au	Moins de 1 an (\$)	De 1 à 5 ans (\$)	Plus de 5 ans (\$)
30 juin 2017	7 980	40 791	13 507
31 décembre 2016	11 656	41 184	15 819

FONDS SSQ TRÉSORERIE OGP

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Risque de taux d'intérêt (suite)

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation des taux d'intérêt en vigueur serait :

Variation (%)	30 juin 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+1	(1 762)	(1 916)
-1	1 762	1 916

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

Risque de prix

Le Fonds effectue des transactions de titres à revenu fixe et de titres de marché monétaire qui doivent rencontrer les exigences de la politique de placement. Le Fonds investit de 85 % à 100 % dans des titres obligataires et jusqu'à un maximum de 15 % dans des titres du marché monétaire.

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation de son indice obligataire canadien de référence serait :

Variation (%)	30 juin 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+2	1 246	1 373
-2	(1 246)	(1 373)

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 2017 et au 31 décembre 2016, tous les titres du Fonds sont libellés en dollars canadiens, la devise fonctionnelle. Par conséquent, le Fonds n'est pas exposé au risque de change.

Risque de concentration

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

Catégories de placement	30 juin 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Obligations canadiennes		
Fédérales	11,02	13,60
Provinciales	10,95	6,16
Municipales	50,09	49,39
De sociétés	27,01	29,92
Autres éléments d'actif net	0,93	0,93
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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	62 278	-	62 278
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	-	62 278	-	62 278

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	68 659	-	68 659
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	-	68 659	-	68 659

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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 2017	31 décembre 2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	293 390	333 837
Trésorerie	481	2 090
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	293 871	335 927
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	2 235
Autres créditeurs	58	60
Total du passif	58	2 295
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	293 813	333 632
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,41	11,22
Classe B	11,24	11,10
Classe C	11,42	11,22
Classe D	11,34	11,17
Classe E	11,42	11,22
Classe F	11,41	11,22
Classe G	11,39	11,21
Classe H	11,34	11,17
Classe I	11,84	11,51
Classe J	11,84	11,51
Classe K	11,84	11,51
Classe N	11,42	11,22

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(75)	41
Non réalisé(e) sur les placements	7 747	10 682
Total gain net (perte nette)	7 672	10 723
Intérêts aux fins d'attribution	2	2
Distributions par le fonds sous-jacent	1 946	1 709
	9 620	12 434
Charges		
Frais de gestion (note 6)	685	688
Frais d'administration	30	30
Frais de transactions	-	-
	715	718
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	8 905	11 716
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,20	0,36
Classe B	0,15	0,31
Classe C	0,20	0,36
Classe D	0,18	0,34
Classe E	0,21	0,36
Classe F	0,20	0,36
Classe G	0,20	0,35
Classe H	0,18	0,34
Classe I	0,34	0,49
Classe J	0,34	0,49
Classe K	0,34	0,50
Classe N	0,20	0,36

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	333 632	286 915
Opérations sur les parts		
Parts émises	22 781	53 438
Parts rachetées	(71 505)	(20 080)
	(48 724)	33 358
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	8 905	11 716
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	293 813	331 989

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	8 905	11 716
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(7 672)	(10 723)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 946)	(1 709)
	(713)	(716)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 085)	(38 190)
Cessions	53 150	5 910
	50 065	(32 280)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2 237)	9 913
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	47 115	(23 083)
Financement		
Parts émises	22 781	53 438
Parts rachetées	(71 505)	(20 080)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(48 724)	33 358
Variation nette de la trésorerie	(1 609)	10 275
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	2 090	(3 924)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	481	6 351
Intérêts reçus	2	2
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,86 %)				
Fonds Fiera Obligations - Gestion active	66,84	17 730 399	193 173	196 389
Fonds Fiera Obligations - Gestion tactique	33,01	9 356 839	101 490	97 001
TOTAL DES PLACEMENTS (99,86 %)			294 663	293 390
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,14 %)				423
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				293 813

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Obligations - Gestion active</i>	%
Gouvernement du Canada, 1,00 %, 01-06-2027	9,70
Fiera Capital Gestion active - municipale à court terme	9,14
Province de l'Ontario, 2,85 %, 02-06-2023	7,03
Gouvernement du Canada, 2,75 %, 01-06-2022	5,21
Province de l'Ontario, 2,80 %, 02-06-2048	4,69

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Obligations - Gestion tactique</i>	%
Gouvernement du Canada, 0,50 %, 01-08-2018	5,60
Gouvernement du Canada, 2,75 %, 01-12-2048	5,58
Royal Office Finance LP, 5,21 %, 12-11-2032	5,23
Toronto Community Housing Corp., 4,88 %, 11-05-2037	4,82
Province de l'Ontario, 3,50 %, 02-06-2024	4,21

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 Obligations - Gestion active et Fiera Obligations - Gestion tactique. 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 Obligations - Gestion active (approche de gestion basée sur la durée, la courbe d'échéance et le crédit) et 33 % du Fonds Fiera Obligations - Gestion tactique (approche de gestion qui met l'accent sur la gestion de la 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	293 390	-	-	293 390
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	293 390	-	-	293 390

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	333 837	-	-	333 837
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	333 837	-	-	333 837

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS OGP

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	56 987	59 643
Trésorerie	158	1 038
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	3
Total de l'actif	57 145	60 684
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	1 235
Autres créditeurs	12	9
Total du passif	12	1 244
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	57 133	59 440
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,80	11,62
Classe B	11,63	11,50
Classe C	11,81	11,62
Classe E	11,82	11,63
Classe F	11,81	11,62
Classe G	11,79	11,60
Classe I	12,26	11,93
Classe J	12,25	11,92
Classe N	11,81	11,62

FONDS SSQ OBLIGATIONS OGP

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(1)	12
Non réalisé(e) sur les placements	669	1 438
Total gain net (perte nette)	668	1 450
Distributions par le fonds sous-jacent	956	675
	1 624	2 125
Charges		
Frais de gestion (note 6)	284	201
Frais d'administration	13	9
Frais de transactions	-	-
	297	210
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 327	1 915
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,19	0,36
Classe B	0,14	0,30
Classe C	0,19	0,36
Classe E	0,19	0,37
Classe F	0,19	0,36
Classe G	0,18	0,35
Classe I	0,34	0,49
Classe J	0,33	0,49
Classe N	0,19	0,36

FONDS SSQ OBLIGATIONS OGP

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	59 440	48 451
Opérations sur les parts		
Parts émises	7 328	9 548
Parts rachetées	(10 962)	(4 983)
	(3 634)	4 565
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 327	1 915
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	57 133	54 931

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 327	1 915
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(668)	(1 450)
Distributions par le fonds sous-jacent	(956)	(675)
	(297)	(210)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 915)	(4 256)
Cessions	6 195	515
	4 280	(3 741)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1 229)	(202)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	2 754	(4 153)
Financement		
Parts émises	7 328	9 548
Parts rachetées	(10 962)	(4 983)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 634)	4 565
Variation nette de la trésorerie	(880)	412
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	1 038	174
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	158	586
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS OGP

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,74 %)			
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	5 374 121	57 055	56 987
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,26 %)			146
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			57 133

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes</i>	%
Province de Québec, 8,50 %, 01-04-2026	9,44
Gouvernement du Canada, 3,50 %, 01-12-2045	5,36
Province de l'Ontario, 6,50 %, 08-03-2029	3,31
Gouvernement du Canada, 5,00 %, 01-06-2037	2,60
Hydro-Québec, 1,04 %, 01-12-2019	2,20
Gouvernement du Canada, 5,75 %, 01-06-2029	1,71
Val-d'Or, 1,90 %, 01-09-2021	1,41
Ville de Westmount, 3,60 %, 21-08-2023	1,38
Administration financière des Premières nations, 3,40 %, 26-06-2024	1,20
CHUM Collectif, 6,72 %, 30-09-2049	1,19

FONDS SSQ OBLIGATIONS OGP

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations OGP est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Caisse Commune Optimum obligations canadiennes. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations OGP 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 Optimum Gestion de Placements selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion basée sur l'anticipation des taux d'intérêt et la gestion de la courbe d'échéance. Le choix des secteurs, le choix des titres, la gestion des écarts de crédit et la synchronisation des interventions sont également considérés.

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	56 987	-	-	56 987
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	56 987	-	-	56 987

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	59 643	-	-	59 643
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	59 643	-	-	59 643

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	112 122	121 637
Trésorerie	330	167
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	6	-
Total de l'actif	112 458	121 804
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	56	53
Total du passif	56	53
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	112 402	121 751
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,72	10,61
Classe B	10,57	10,50
Classe C	10,73	10,62
Classe E	10,73	10,62
Classe F	10,73	10,61
Classe G	10,71	10,60
Classe I	11,16	10,91
Classe J	11,16	10,91
Classe N	10,73	10,61

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	154	30
Non réalisé(e) sur les placements	614	2 137
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	161	-
Total gain net (perte nette)	929	2 167
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 771	2 053
	2 701	4 220
Charges		
Frais de gestion (note 6)	535	613
Frais d'administration	23	26
Frais de transactions	-	-
	558	639
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 143	3 581
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,12	0,27
Classe B	0,07	0,23
Classe C	0,12	0,28
Classe E	0,12	0,28
Classe F	0,12	0,28
Classe G	0,11	0,27
Classe I	0,25	0,41
Classe J	0,25	0,41
Classe N	0,12	0,28

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	121 751	111 288
Opérations sur les parts		
Parts émises	13 844	24 437
Parts rachetées	(25 336)	(9 770)
	(11 492)	14 667
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 143	3 581
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	112 402	129 536

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 143	3 581
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(768)	(2 167)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 932)	(2 053)
	(557)	(639)
Transactions de placements		
Acquisitions	(625)	(14 365)
Cessions	12 840	1 325
	12 215	(13 040)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(3)	13 505
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	11 655	(174)
Financement		
Parts émises	13 844	24 437
Parts rachetées	(25 336)	(9 770)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(11 492)	14 667
Variation nette de la trésorerie	163	14 493
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	167	157
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	330	14 650
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,75 %)			
PIMCO Canada Canadian CorePLUS Bond Trust	1 072 832	111 434	112 122
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,25 %)			280
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			112 402

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>PIMCO Canada Canadian CorePLUS Bond Trust</i>	%
Fin Fut CAN 10Y BOND MSE, 6,00 %, 21-09-2017	7,90
IRS CAD, 1,45 %, 13-12-2019	7,50
Province de l'Ontario, 3,50 %, 02-06-2024	4,70
FNMA TBA, 3,00 %, 14-08-2047	4,60
IRS CAD, 1,20 %, 14-06-2019	4,60
IRS USD, 1,25 %, 21-12-2018	4,40
Province de l'Ontario, 3,15 %, 02-06-2022	3,80
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 2,25 %, 15-12-2025	3,00
IRS CAD, 1,50 %, 14-02-2022	2,90
Province de l'Ontario, 3,45 %, 06-02-2045	2,70

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	112 122	-	-	112 122
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	112 122	-	-	112 122

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	121 637	-	-	121 637
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	121 637	-	-	121 637

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	29 957	22 270
Trésorerie	9	73
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	5	5
Total de l'actif	29 971	22 348
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	18	13
Total du passif	18	13
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	29 953	22 335
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,97	10,67
Classe B	10,81	10,56
Classe C	10,99	10,68
Classe E	10,99	10,68
Classe F	10,98	10,67
Classe G	10,94	10,65
Classe I	11,50	11,02
Classe J	11,50	11,02
Classe N	10,99	10,68

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	3	(43)
Non réalisé(e) sur les placements	588	195
Total gain net (perte nette)	591	152
Distributions par le fonds sous-jacent	541	531
	1 132	683
Charges		
Frais de gestion (note 6)	217	145
Frais d'administration	8	5
Frais de transactions	-	-
	225	150
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	907	533
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,30	0,22
Classe B	0,25	0,17
Classe C	0,30	0,22
Classe E	0,30	0,22
Classe F	0,30	0,22
Classe G	0,29	0,21
Classe I	0,47	0,37
Classe J	0,47	0,37
Classe N	0,30	0,22

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	22 335	17 373
Opérations sur les parts		
Parts émises	11 516	6 282
Parts rachetées	(4 805)	(3 782)
	6 711	2 500
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	907	533
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	29 953	20 406

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	907	533
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(591)	(152)
Distributions par le fonds sous-jacent	(541)	(531)
	(225)	(150)
Transactions de placements		
Acquisitions	(7 026)	(3 366)
Cessions	471	1 026
	(6 555)	(2 340)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	5	(1 375)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(6 775)	(3 865)
Financement		
Parts émises	11 516	6 282
Parts rachetées	(4 805)	(3 782)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	6 711	2 500
Variation nette de la trésorerie	(64)	(1 365)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	73	1 439
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	9	74
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,01 %)				
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	33,42	696 415	9 961	10 012
Fonds d'obligations à stratégie avantageuse mondiales PIMCO (Canada), Série I	66,59	1 923 283	20 016	19 945
TOTAL DES PLACEMENTS (100,01 %)			29 977	29 957
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,01 %)				(4)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				29 953

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Titres du trésor des États-Unis, 2,13 %, 29-02-2024	2,96
Gouvernement du Japon, Bon du trésor, (0,11 %), 19-09-2017	2,89
Titres du trésor des États-Unis, 2,25 %, 31-12-2023	2,53
Gouvernement du Canada, Bon du trésor, 0,57 %, 16-11-2017	2,32
Energy Future Intermediate Holding Co LCC, Prêt bancaire	1,67

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds d'obligations à stratégie avantageuse mondiales PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Freddie Mac TBA, 3,00 %, 01-02-2047	6,30
Gouvernement du Japon, Bons du trésor, (0,12 %), 04-09-2017	3,50
Gouvernement du Japon, Bons du trésor, (0,12 %), 28-08-2017	3,50
Titres du trésor des États-Unis, protégés contre l'inflation, 0,13 %, 15-07-2024	3,00
Banque royale du Canada, 0,50 %, 05-07-2017	2,80

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 à stratégie avantageuse mondiales 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 à stratégie avantageuse mondiales PIMCO (Canada) (approche de gestion active en obligations mondiales qui met l'emphasis 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	29 957	-	-	29 957
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	29 957	-	-	29 957

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	22 270	-	-	22 270
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	22 270	-	-	22 270

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	15 543	2 281
Trésorerie	141	55
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	15 684	2 336
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	50
Autres créditeurs	-	-
Total du passif	-	50
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	15 684	2 286
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,44	10,12
Classe B	10,38	10,11
Classe E	10,45	10,12
Classe F	10,44	10,12
Classe G	10,43	10,11
Classe I	10,62	10,15
Classe J	10,62	10,15
Classe N	10,45	10,12

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

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

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL		2017
Période terminée le 30 juin		\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements		-
Non réalisé(e) sur les placements		112
Distribué(e) par le fonds sous-jacent		58
Total gain net (perte nette)		170
Distributions par le fonds sous-jacent		253
		423
Charges		
Frais de gestion (note 6)		140
Frais d'administration		5
Frais de transactions		-
		145
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs		278
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A		0,26
Classe B		0,22
Classe E		0,27
Classe F		0,26
Classe G		0,26
Classe I		0,41
Classe J		0,41
Classe N		0,27

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

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

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

Période terminée le 30 juin	2017
	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	2 286
Opérations sur les parts	
Parts émises	14 589
Parts rachetées	(1 469)
	13 120
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	278
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	15 684

ÉTAT DES FLUX DE TRÉSORERIE

Période terminée le 30 juin	2017
	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:	
Opérationnelles	
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	278
Éléments sans incidence sur la trésorerie	
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(112)
Distributions par le fonds sous-jacent	(311)
	(145)
Transactions de placements	
Acquisitions	(12 874)
Cessions	35
	(12 839)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(50)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(13 034)
Financement	
Parts émises	14 589
Parts rachetées	(1 469)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	13 120
Variation nette de la trésorerie	86
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	55
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	141
Intérêts reçus	-
Dividendes reçus	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,10 %)			
Fonds obligations de sociétés Signature, Catégorie I	1 418 195	15 420	15 543
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,90 %)			141
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			15 684

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds obligations de sociétés Signature, Catégorie I</i>	%
Harvest Operations Corp.	0,82
Royal Bank of Scotland Group PLC	0,72
Credit Suisse Group AG	0,72
GMAC Capital Trust I	0,62
Lloyds Banking Group PLC	0,62
Lincoln National Corp.	0,62
Citigroup Inc.	0,51
Goldman Sachs Group Inc.	0,51
Amaya Holdings	0,51
Banque Royale du Canada	0,51

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations de sociétés CI Signature est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent obligations de sociétés Signature, Catégorie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations de sociétés CI Signature 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 Placements 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	15 543	-	-	15 543
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	15 543	-	-	15 543

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	2 281	-	-	2 281
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	2 281	-	-	2 281

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	50 436	50 996
Trésorerie	79	326
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	50 515	51 322
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	280
Autres créditeurs	20	20
Total du passif	20	300
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	50 495	51 022
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,59	11,45
Classe B	11,42	11,34
Classe C	11,60	11,46
Classe E	11,60	11,46
Classe F	11,59	11,45
Classe G	11,57	11,44
Classe I	12,04	11,76
Classe J	12,03	11,76
Classe N	11,61	11,46

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(119)	214
Non réalisé(e) sur les placements	313	891
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	202	256
Total gain net (perte nette)	396	1 361
Distributions par le fonds sous-jacent	724	839
	1 120	2 200
Charges		
Frais de gestion (note 6)	36	39
Frais d'administration	1	1
Frais de transactions	-	-
	37	40
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 083	2 160
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,13	0,33
Classe B	0,08	0,28
Classe C	0,13	0,33
Classe E	0,13	0,34
Classe F	0,13	0,33
Classe G	0,12	0,33
Classe I	0,27	0,48
Classe J	0,27	0,47
Classe N	0,13	0,34

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	51 022	52 311
Opérations sur les parts		
Parts émises	5 502	6 570
Parts rachetées	(7 112)	(11 153)
	(1 610)	(4 583)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 083	2 160
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	50 495	49 888

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 083	2 160
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(194)	(1 105)
Distributions par le fonds sous-jacent	(926)	(1 095)
	(37)	(40)
Transactions de placements		
Acquisitions	(4 145)	(5 125)
Cessions	5 825	9 740
	1 680	4 615
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(280)	(7 743)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 363	(3 168)
Financement		
Parts émises	5 502	6 570
Parts rachetées	(7 112)	(11 153)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 610)	(4 583)
Variation nette de la trésorerie	(247)	(7 751)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	326	63
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	79	(7 688)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,88 %)			
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D	1 849 801	50 523	50 436
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,12 %)			59
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			50 495

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D</i>	%
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-03-2020	1,25
Gouvernement du Canada, 4,00 %, 01-06-2041	1,19
Gouvernement du Canada, 3,75 %, 01-06-2019	1,19
Gouvernement du Canada, 5,00 %, 01-06-2037	1,15
Gouvernement du Canada, 3,50 %, 01-12-2045	1,11
Gouvernement du Canada, 0,75 %, 01-09-2020	1,02
Gouvernement du Canada, 5,75 %, 01-06-2033	1,01
Province de l'Ontario, 2,90 %, 02-12-2046	0,93
Province de l'Ontario, 3,45 %, 02-06-2045	0,92
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	0,90

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	50 436	-	-	50 436
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	50 436	-	-	50 436

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	50 996	-	-	50 996
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	50 996	-	-	50 996

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

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 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	102 037	105 547
Trésorerie	-	228
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	9	44
Total de l'actif	102 046	105 819
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	354	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	29	27
Total du passif	383	27
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	101 663	105 792
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,51	12,29
Classe B	12,32	12,16
Classe C	12,55	12,32
Classe E	12,56	12,32
Classe F	12,53	12,31
Classe G	12,49	12,27
Classe I	13,12	12,71
Classe J	13,16	12,74
Classe L	11,69	11,32
Classe N	12,56	12,32

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	534	1 069
Non réalisé(e) sur les placements	2 355	2 311
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	5	-
Total gain net (perte nette)	2 894	3 380
Intérêts aux fins d'attribution	1	1
Distributions par le fonds sous-jacent	601	484
	3 496	3 865
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 438	1 333
Frais d'administration	51	47
Frais de transactions	-	-
	1 489	1 380
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 007	2 485
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,23	0,30
Classe B	0,17	0,25
Classe C	0,24	0,32
Classe E	0,24	0,32
Classe F	0,24	0,31
Classe G	0,22	0,30
Classe I	0,43	0,48
Classe J	0,42	0,51
Classe L	0,38	0,43
Classe N	0,24	0,32

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	105 792	96 876
Opérations sur les parts		
Parts émises	18 946	14 261
Parts rachetées	(25 082)	(13 538)
	(6 136)	723
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 007	2 485
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	101 663	100 084

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 007	2 485
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 889)	(3 380)
Distributions par le fonds sous-jacent	(606)	(484)
	(1 488)	(1 379)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 202)	(23 351)
Cessions	9 207	24 632
	7 005	1 281
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	37	51
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	5 554	(47)
Financement		
Parts émises	18 946	14 261
Parts rachetées	(25 082)	(13 538)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(6 136)	723
Variation nette de la trésorerie	(582)	676
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	228	100
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(354)	776
Intérêts reçus	1	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)
 Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,37 %)				
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	27,64	2 650 234	28 767	28 103
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K	10,17	917 149	10 330	10 335
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	27,61	2 370 278	28 232	28 073
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	5,07	160 226	5 147	5 153
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	10,05	622 988	9 413	10 218
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton, Classe K	5,08	450 134	4 524	5 163
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	2,93	103 940	2 347	2 975
Fonds Hexavest Mondial tous les pays	3,94	4 014	4 126	4 008
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	2,92	196 238	2 173	2 966
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A	4,96	264 820	4 133	5 043
TOTAL DES PLACEMENTS (100,37 %)			99 192	102 037
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,37 %)				(374)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				101 663

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 2017 (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 Caisse Commune Optimum obligations canadiennes (page 85)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K (page 8)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton, Classe K (page 148)	Placements Montrusco Bolton

Actions étrangères (15 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds Hexavest Mondial tous les pays (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A (page 85)	Corporation Fiera Capital

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	102 037	-	-	102 037
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	102 037	-	-	102 037

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	105 547	-	-	105 547
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	105 547	-	-	105 547

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	226 148	242 579
Trésorerie	118	287
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	1
Total de l'actif	226 266	242 867
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	100	-
Autres créditeurs	115	136
Total du passif	215	136
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	226 051	242 731
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,80	12,60
Classe B	12,64	12,49
Classe C	12,87	12,65
Classe E	12,87	12,65
Classe F	12,81	12,61
Classe G	12,74	12,56
Classe I	13,47	13,06
Classe J	13,47	13,06
Classe L	12,14	11,77
Classe N	12,87	12,65

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILBRÉE

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2 729	1 060
Non réalisé(e) sur les placements	4 030	6 809
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	3	-
Total gain net (perte nette)	6 762	7 869
Intérêts aux fins d'attribution	1	1
Distributions par le fonds sous-jacent	1 133	1 038
	7 896	8 908
Charges		
Frais de gestion (note 6)	3 085	3 158
Frais d'administration	106	108
Frais de transactions	-	3
	3 191	3 269
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 705	5 639
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,22	0,26
Classe B	0,17	0,21
Classe C	0,24	0,28
Classe E	0,24	0,28
Classe F	0,23	0,26
Classe G	0,20	0,24
Classe I	0,44	0,45
Classe J	0,44	0,45
Classe L	0,40	0,41
Classe N	0,24	0,28

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILBRÉE

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	242 731	242 982
Opérations sur les parts		
Parts émises	38 747	26 141
Parts rachetées	(60 132)	(27 162)
	(21 385)	(1 021)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 705	5 639
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	226 051	247 600

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 705	5 639
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(6 759)	(7 869)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 136)	(1 038)
	(3 190)	(3 268)
Transactions de placements		
Acquisitions	(5 264)	(53 267)
Cessions	29 590	57 694
	24 326	4 427
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	80	68
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	21 216	1 227
Financement		
Parts émises	38 747	26 141
Parts rachetées	(60 132)	(27 162)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(21 385)	(1 021)
Variation nette de la trésorerie	(169)	206
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	287	415
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	118	621
Intérêts reçus	1	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILBRÉE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,04 %)				
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	20,11	4 287 030	46 432	45 460
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K	5,07	1 016 754	11 442	11 457
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	20,09	3 835 490	44 595	45 426
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	7,07	496 784	15 574	15 977
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	5,07	49 493	8 980	11 456
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	11,03	1 519 619	22 118	24 925
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton, Classe K	7,08	1 394 995	14 032	16 000
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,94	311 031	6 895	8 903
Fonds Hexavest Mondial tous les pays	5,90	13 370	13 789	13 349
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,87	578 448	6 306	8 743
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A	5,89	699 806	10 877	13 325
Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund	4,92	405 942	9 497	11 127
TOTAL DES PLACEMENTS (100,04 %)			210 537	226 148
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,04 %)				(97)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				226 051

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

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

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILIBRÉE

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 Caisse Commune Optimum obligations canadiennes (page 85)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K (page 8)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (30 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core" (page 85)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille
Fonds SSQ Actions canadiennes Monrusco Bolton, Classe K (page 148)	Placements Monrusco Bolton

Actions étrangères (25 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds Hexavest Mondial tous les pays (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A (page 85)	Corporation Fiera Capital
Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund (page 85)	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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	226 148	-	-	226 148
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	226 148	-	-	226 148

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	242 579	-	-	242 579
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	242 579	-	-	242 579

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	57 401	62 935
Trésorerie	-	325
Cession de placements à recevoir	100	-
Autres débiteurs	2	1
Total de l'actif	57 503	63 261
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	40	-
Achat de placements à payer	-	91
Autres créditeurs	47	64
Total du passif	87	155
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	57 416	63 106
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,61	14,33
Classe B	14,47	14,22
Classe C	14,73	14,41
Classe E	14,73	14,41
Classe F	14,64	14,34
Classe G	14,52	14,26
Classe I	15,43	14,88
Classe J	15,51	14,95
Classe L	12,54	12,10
Classe N	14,73	14,41

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 327	72
Non réalisé(e) sur les placements	955	1 918
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1	-
Total gain net (perte nette)	2 283	1 990
Distributions par le fonds sous-jacent	259	223
	2 542	2 213
Charges		
Frais de gestion (note 6)	842	822
Frais d'administration	28	28
Frais de transactions	1	1
	871	851
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 671	1 362
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,34	0,28
Classe B	0,29	0,24
Classe C	0,38	0,32
Classe E	0,38	0,32
Classe F	0,35	0,29
Classe G	0,31	0,26
Classe I	0,61	0,51
Classe J	0,62	0,51
Classe L	0,50	0,42
Classe N	0,38	0,32

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	63 106	60 342
Opérations sur les parts		
Parts émises	10 329	4 549
Parts rachetées	(17 690)	(5 646)
	(7 361)	(1 097)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 671	1 362
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	57 416	60 607

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 671	1 362
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 282)	(1 990)
Distributions par le fonds sous-jacent	(260)	(223)
	(871)	(851)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 793)	(13 061)
Cessions	10 869	15 321
	8 076	2 260
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(209)	26
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	6 996	1 435
Financement		
Parts émises	10 329	4 549
Parts rachetées	(17 690)	(5 646)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(7 361)	(1 097)
Variation nette de la trésorerie	(365)	338
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	325	33
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(40)	371
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,97 %)				
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	15,12	818 858	8 864	8 683
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	15,04	729 188	8 488	8 636
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	8,05	143 650	4 667	4 620
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	6,05	15 019	2 695	3 476
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	13,06	457 266	6 551	7 500
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton, Classe K	8,04	402 321	4 071	4 615
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	6,96	139 536	3 094	3 994
Fonds Hexavest Mondial tous les pays	7,87	4 527	4 609	4 520
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	6,84	259 690	2 811	3 925
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A	6,90	208 130	3 254	3 963
Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund	6,04	126 530	2 954	3 469
TOTAL DES PLACEMENTS (99,97 %)			52 058	57 401
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,03 %)				15
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				57 416

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez 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 2017 (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 Caisse Commune Optimum obligations canadiennes (page 85)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (35 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core" (page 85)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton, Classe K (page 148)	Placements Montrusco Bolton

Actions étrangères (35 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds Hexavest Mondial tous les pays (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A (page 85)	Corporation Fiera Capital
Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund (page 85)	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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	57 401	-	-	57 401
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	57 401	-	-	57 401

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	62 935	-	-	62 935
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	62 935	-	-	62 935

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	30 939	30 000
Trésorerie	141	242
Cession de placements à recevoir	20	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	31 100	30 242
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	45	5
Autres créditeurs	59	59
Total du passif	104	64
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	30 996	30 178
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,67	13,40
Classe B	13,50	13,28
Classe C	13,78	13,48
Classe E	13,79	13,48
Classe F	13,67	13,40
Classe G	13,55	13,32
Classe I	14,47	13,94
Classe J	14,55	14,01
Classe L	13,00	12,52
Classe N	13,79	13,48

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	551	(91)
Non réalisé(e) sur les placements	470	670
Total gain net (perte nette)	1 021	579
Distributions par le fonds sous-jacent	113	84
	1 134	663
Charges		
Frais de gestion (note 6)	375	357
Frais d'administration	12	12
Frais de transactions	-	1
	387	370
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	747	293
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,27	0,08
Classe B	0,21	0,03
Classe C	0,30	0,11
Classe E	0,31	0,11
Classe F	0,27	0,08
Classe G	0,23	0,05
Classe I	0,53	0,30
Classe J	0,54	0,30
Classe L	0,47	0,27
Classe N	0,31	0,11

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	30 178	29 310
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 560	2 636
Parts rachetées	(8 489)	(2 811)
	71	(175)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	747	293
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	30 996	29 428

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	747	293
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 021)	(579)
Distributions par le fonds sous-jacent	(113)	(84)
	(387)	(370)
Transactions de placements		
Acquisitions	(5 280)	(7 013)
Cessions	5 475	7 808
	195	795
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	20	23
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(172)	448
Financement		
Parts émises	8 560	2 636
Parts rachetées	(8 489)	(2 811)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	71	(175)
Variation nette de la trésorerie	(101)	273
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	242	23
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	141	296
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,82 %)				
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	10,07	294 475	3 187	3 123
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	10,07	263 633	3 102	3 122
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	9,08	87 469	2 873	2 813
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	7,07	9 470	1 773	2 192
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	15,04	284 293	4 419	4 663
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton, Classe K	9,06	244 740	2 507	2 807
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	7,38	79 852	1 952	2 286
Fonds Hexavest Mondial tous les pays	9,85	3 057	3 200	3 052
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	7,33	150 409	1 737	2 273
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A	7,93	129 049	2 047	2 457
Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund	6,94	78 475	1 925	2 151
TOTAL DES PLACEMENTS (99,82 %)			28 722	30 939
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,18 %)				57
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				30 996

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez 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 2017 (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 Caisse Commune Optimum obligations canadiennes (page 85)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (40 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core" (page 85)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille
Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton, Classe K (page 148)	Placements Montrusco Bolton

Actions étrangères (40 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds Hexavest Mondial tous les pays (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A (page 85)	Corporation Fiera Capital
Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund (page 85)	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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	30 939	-	-	30 939
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	30 939	-	-	30 939

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	30 000	-	-	30 000
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	30 000	-	-	30 000

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	94 118	94 041
Trésorerie	-	526
Cession de placements à recevoir	120	-
Autres débiteurs	12	-
Total de l'actif	94 250	94 567
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	174	-
Achat de placements à payer	65	-
Autres créditeurs	39	42
Total du passif	278	42
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	93 972	94 525
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,42	12,19
Classe B	12,24	12,06
Classe C	12,47	12,22
Classe E	12,47	12,22
Classe F	12,43	12,19
Classe G	12,38	12,16
Classe I	13,05	12,62
Classe J	13,11	12,67
Classe N	12,47	12,22

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	313	152
Non réalisé(e) sur les placements	2 161	1 698
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1	-
Total gain net (perte nette)	2 475	1 850
Distributions par le fonds sous-jacent	842	581
	3 317	2 431
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 318	1 175
Frais d'administration	46	41
Frais de transactions	-	-
	1 364	1 216
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 953	1 215
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,24	0,15
Classe B	0,18	0,10
Classe C	0,25	0,17
Classe E	0,25	0,17
Classe F	0,24	0,16
Classe G	0,22	0,14
Classe I	0,45	0,34
Classe J	0,43	0,35
Classe N	0,25	0,17

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	94 525	85 411
Opérations sur les parts		
Parts émises	21 487	17 765
Parts rachetées	(23 993)	(16 132)
	(2 506)	1 633
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 953	1 215
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	93 972	88 259

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 953	1 215
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 474)	(1 850)
Distributions par le fonds sous-jacent	(843)	(581)
	(1 364)	(1 216)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 384)	(37 296)
Cessions	13 624	36 270
	3 240	(1 026)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(70)	65
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 806	(2 177)
Financement		
Parts émises	21 487	17 765
Parts rachetées	(23 993)	(16 132)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(2 506)	1 633
Variation nette de la trésorerie	(700)	(544)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	526	405
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(174)	(139)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)
Au 30 juin 2017 (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 obligations de sociétés Signature, Catégorie I	8,10	694 823	7 650	7 615
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	14,05	1 245 270	13 607	13 205
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	12,21	798 196	11 421	11 475
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K	10,07	839 829	9 468	9 464
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	16,03	1 271 786	15 041	15 063
Guardian Equity Income Fund, Serie I	8,01	405 103	6 971	7 527
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	6,03	176 348	5 564	5 671
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	6,00	343 811	5 424	5 639
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	4,01	131 460	3 100	3 763
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,88	240 947	2 826	3 642
Fonds Hexavest Mondial	5,88	5 544	5 830	5 521
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	5,89	385 988	5 205	5 533
TOTAL DES PLACEMENTS (100,16 %)			92 107	94 118
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,16 %)				(146)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				93 972

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 2017 (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 obligations de sociétés Signature, Catégorie I (page 85)	Placement CI
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes (page 85)	Optimum Gestion de Placements
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 85)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K (page 8)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Guardian Equity Income Fund, Série I (page 85)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Hexavest Mondial (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 85)	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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	94 118	-	-	94 118
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	94 118	-	-	94 118

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	94 041	-	-	94 041
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	94 041	-	-	94 041

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	145 093	156 233
Trésorerie	335	276
Cession de placements à recevoir	150	-
Autres débiteurs	2	-
Total de l'actif	145 580	156 509
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	165
Autres créditeurs	72	85
Total du passif	72	250
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	145 508	156 259
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,81	12,54
Classe B	12,67	12,44
Classe C	12,90	12,60
Classe E	12,91	12,60
Classe F	12,84	12,56
Classe G	12,75	12,50
Classe I	13,53	13,02
Classe J	13,60	13,10
Classe N	12,90	12,60

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 726	(1 409)
Non réalisé(e) sur les placements	3 248	4 476
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	5	-
Total gain net (perte nette)	4 979	3 067
Intérêts aux fins d'attribution	1	1
Distributions par le fonds sous-jacent	1 246	975
	6 226	4 043
Charges		
Frais de gestion (note 6)	2 322	2 136
Frais d'administration	78	71
Frais de transactions	-	-
	2 400	2 207
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 826	1 836
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,30	0,14
Classe B	0,25	0,10
Classe C	0,33	0,17
Classe E	0,33	0,17
Classe F	0,31	0,15
Classe G	0,28	0,12
Classe I	0,54	0,34
Classe J	0,53	0,34
Classe N	0,33	0,17

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	156 259	143 134
Opérations sur les parts		
Parts émises	29 216	20 172
Parts rachetées	(43 793)	(16 285)
	(14 577)	3 887
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 826	1 836
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	145 508	148 857

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 826	1 836
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(4 974)	(3 067)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 251)	(975)
	(2 399)	(2 206)
Transactions de placements		
Acquisitions	(12 160)	(54 193)
Cessions	29 525	51 926
	17 365	(2 267)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(330)	(603)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	14 636	(5 076)
Financement		
Parts émises	29 216	20 172
Parts rachetées	(43 793)	(16 285)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(14 577)	3 887
Variation nette de la trésorerie	59	(1 189)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	276	1 156
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	335	(33)
Intérêts reçus	1	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)
Au 30 juin 2017 (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 obligations de sociétés Signature, Catégorie I	6,57	871 935	9 600	9 556
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	8,07	1 107 542	12 103	11 744
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	10,12	1 023 876	14 654	14 720
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K	5,08	656 060	7 407	7 393
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	10,53	1 293 798	15 186	15 323
Guardian Equity Income Fund, Serie I	12,01	940 566	16 121	17 476
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	9,04	409 126	12 981	13 158
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	8,94	793 550	12 201	13 016
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,90	198 423	4 601	5 680
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,89	374 567	4 183	5 661
Fonds Hexavest Mondial	5,87	8 573	8 988	8 537
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	5,88	597 119	8 043	8 559
Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund	4,90	313 748	5 418	7 124
Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley, Classe K	4,91	444 839	6 056	7 146
TOTAL DES PLACEMENTS (99,71 %)			137 542	145 093
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,29 %)				415
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				145 508

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez 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 2017 (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 obligations de sociétés Signature, Catégorie I (page 85)	Placement CI
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes (page 85)	Optimum Gestion de Placements
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 85)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Trésorerie OGP, Classe K (page 8)	Optimum Gestion de Placements
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (30 %)

Fonds	Gestionnaires
Guardian Equity Income Fund, Série I (page 85)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (20 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Hexavest Mondial (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 85)	Gestion de Placements TD

Fonds spécialisés (10 %)

Fonds	Gestionnaires
Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund (page 85)	Lazard Asset Management
Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley, Classe K (page 250)	Morgan Stanley Investment 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	145 093	-	-	145 093
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	145 093	-	-	145 093

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	156 233	-	-	156 233
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	156 233	-	-	156 233

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	55 994	62 669
Trésorerie	376	48
Cession de placements à recevoir	50	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	56 420	62 717
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	50	-
Autres créditeurs	60	75
Total du passif	110	75
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	56 310	62 642
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,42	13,12
Classe B	13,28	13,03
Classe C	13,53	13,20
Classe E	13,54	13,20
Classe F	13,44	13,13
Classe G	13,33	13,06
Classe I	14,20	13,65
Classe J	14,29	13,74
Classe N	13,53	13,20

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 019	(597)
Non réalisé(e) sur les placements	1 122	1 642
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1	-
Total gain net (perte nette)	2 142	1 045
Distributions par le fonds sous-jacent	503	342
	2 645	1 387
Charges		
Frais de gestion (note 6)	924	848
Frais d'administration	31	28
Frais de transactions	-	-
	955	876
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 690	511
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,34	0,09
Classe B	0,30	0,05
Classe C	0,38	0,12
Classe E	0,38	0,12
Classe F	0,35	0,09
Classe G	0,32	0,06
Classe I	0,60	0,30
Classe J	0,60	0,30
Classe N	0,38	0,12

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	62 642	57 740
Opérations sur les parts		
Parts émises	13 815	9 008
Parts rachetées	(21 837)	(7 698)
	(8 022)	1 310
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 690	511
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	56 310	59 561

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 690	511
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 141)	(1 045)
Distributions par le fonds sous-jacent	(504)	(342)
	(955)	(876)
Transactions de placements		
Acquisitions	(4 267)	(24 517)
Cessions	13 587	23 604
	9 320	(913)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(15)	(518)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	8 350	(2 307)
Financement		
Parts émises	13 815	9 008
Parts rachetées	(21 837)	(7 698)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(8 022)	1 310
Variation nette de la trésorerie	328	(997)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	48	695
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	376	(302)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,44 %)				
Fonds obligations de sociétés Signature, Catégorie I	5,04	258 856	2 850	2 837
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes	5,52	293 399	3 203	3 111
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	7,11	278 437	3 991	4 003
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	7,51	357 197	4 181	4 231
Guardian Equity Income Fund, Serie I	15,49	469 318	8 049	8 720
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	11,01	192 777	6 068	6 200
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	11,01	377 887	5 844	6 198
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	4,37	85 970	1 963	2 461
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	4,39	163 625	1 824	2 473
Fonds Hexavest Mondial	7,89	4 460	4 685	4 441
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	8,30	326 111	4 391	4 674
Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund	5,89	146 074	2 476	3 317
Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley, Classe K	5,91	207 159	2 802	3 328
TOTAL DES PLACEMENTS (99,44 %)			52 327	55 994
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,56 %)				316
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				56 310

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Veillez 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 2017 (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 obligations de sociétés Signature, Catégorie I (page 85)	Placement CI
Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes (page 85)	Optimum Gestion de Placements
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 85)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (37,5 %)

Fonds	Gestionnaires
Guardian Equity Income Fund, Série I (page 85)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (25,5 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Hexavest Mondial (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 85)	Gestion de Placements TD

Fonds spécialisés (12 %)

Fonds	Gestionnaires
Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund (page 85)	Lazard Asset Management
Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley, Classe K (page 250)	Morgan Stanley Investment 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	55 994	-	-	55 994
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	55 994	-	-	55 994

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	62 669	-	-	62 669
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	62 669	-	-	62 669

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	37 783	37 877
Trésorerie	-	187
Cession de placements à recevoir	50	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	37 833	38 064
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	7	-
Achat de placements à payer	40	-
Autres créditeurs	58	60
Total du passif	105	60
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	37 728	38 004
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,50	13,18
Classe B	13,33	13,06
Classe C	13,61	13,25
Classe D	13,33	13,06
Classe E	13,62	13,26
Classe F	13,48	13,17
Classe G	13,32	13,06
Classe H	13,16	12,95
Classe I	14,28	13,71
Classe J	14,40	13,82
Classe N	13,61	13,25

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	607	(601)
Non réalisé(e) sur les placements	662	1 041
Total gain net (perte nette)	1 269	440
Distributions par le fonds sous-jacent	296	173
	1 565	613
Charges		
Frais de gestion (note 6)	616	606
Frais d'administration	19	18
Frais de transactions	-	-
	635	624
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	930	(11)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,32	(0,01)
Classe B	0,26	(0,06)
Classe C	0,35	0,02
Classe D	0,26	(0,06)
Classe E	0,36	0,02
Classe F	0,31	(0,01)
Classe G	0,26	(0,06)
Classe H	0,21	(0,10)
Classe I	0,58	0,20
Classe J	0,58	0,20
Classe N	0,35	0,02

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	38 004	40 400
Opérations sur les parts		
Parts émises	11 139	2 780
Parts rachetées	(12 345)	(5 280)
	(1 206)	(2 500)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	930	(11)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	37 728	37 889

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	930	(11)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 269)	(440)
Distributions par le fonds sous-jacent	(296)	(173)
	(635)	(624)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 605)	(14 322)
Cessions	5 264	17 424
	1 659	3 102
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(12)	(151)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 012	2 327
Financement		
Parts émises	11 139	2 780
Parts rachetées	(12 345)	(5 280)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 206)	(2 500)
Variation nette de la trésorerie	(194)	(173)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	187	63
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(7)	(110)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,15 %)				
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	5,12	134 402	1 925	1 932
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	4,99	158 808	1 872	1 881
Guardian Equity Income Fund, Serie I	18,12	367 908	6 377	6 836
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	13,63	159 871	5 048	5 141
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	13,61	313 108	4 870	5 136
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	5,93	78 126	1 771	2 236
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	5,91	147 520	1 590	2 230
Fonds Hexavest Mondial	8,91	3 376	3 530	3 362
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	9,95	262 024	3 570	3 756
Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund	6,95	115 489	1 948	2 622
Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley, Classe K	7,03	165 032	2 213	2 651
TOTAL DES PLACEMENTS (100,15 %)			34 714	37 783
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,15 %)				(55)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				37 728

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 audités)

Période terminée le 30 juin 2017 (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 85)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 15)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (45 %)

Fonds	Gestionnaires
Guardian Equity Income Fund, Série I (page 85)	Guardian Capital LP
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser (page 85)	Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K (page 142)	Triasima Inc. Gestion de portefeuille

Actions étrangères (31 %)

Fonds	Gestionnaires
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K (page 164)	Hillsdale Investment Management
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K (page 196)	C WorldWide Asset Management
Fonds Hexavest Mondial (page 85)	Hexavest Gestion d'actifs
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD (page 85)	Gestion de Placements TD

Fonds spécialisés (14 %)

Fonds	Gestionnaires
Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund (page 85)	Lazard Asset Management
Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley, Classe K (page 250)	Morgan Stanley Investment 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	37 783	-	-	37 783
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	37 783	-	-	37 783

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	37 877	-	-	37 877
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	37 877	-	-	37 877

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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 2017

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD</i>	%
BCE Inc.	1,93
Welltower Inc.	1,90
Vodafone Group PLC	1,90
PPL Corp.	1,84
Imperial Brands PLC	1,80

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Caisse Commune Optimum obligations canadiennes</i>	%
Province de Québec, 8,50 %, 01-04-2026	9,44
Gouvernement du Canada, 3,50 %, 01-12-2045	5,36
Province de l'Ontario, 6,50 %, 08-03-2029	3,31
Gouvernement du Canada, 5,00 %, 01-06-2037	2,60
Hydro-Québec, 1,04 %, 01-12-2019	2,20

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser</i>	%
Banque Toronto-Dominion	8,36
Banque Royale du Canada	7,06
Fonds d'actions spéciales Jarislowsky Fraser	6,70
Banque de Nouvelle-Écosse	6,48
Enbridge Inc.	5,66

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Titres du trésor des États-Unis, 2,13 %, 29-02-2024	2,96
Gouvernement du Japon, Bon du trésor, (0,11 %), 19-09-2017	2,89
Titres du trésor des États-Unis, 2,25 %, 31-12-2023	2,53
Gouvernement du Canada, Bon du trésor, 0,57 %, 16-11-2017	2,32
Energy Future Intermediate Holding Co LCC, Prêt bancaire	1,67

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"</i>	%
Tricon Capital Group Inc.	3,69
Intertape Polymer Group Inc.	3,30
New Flyer Industries Inc.	3,14
Badger Daylighting Ltd.	3,09
Sleep Country Canada	3,08

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Fiera Actions mondiales, Série A</i>	%
Moody's Corp.	5,05
Keyence Corp.	4,50
Johnson & Johnson	4,34
Becton Dickinson and Co.	3,89
Mastercard Inc., Classe A	3,85

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Hexavest Mondial</i>	%
Apple Inc.	2,79
Johnson & Johnson	1,95
Pfizer Inc.	1,76
AT&T Inc.	1,49
Verizon Communications Inc.	1,48

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds Hexavest Mondial tous les pays</i>	%
Apple Inc.	2,39
Johnson & Johnson	1,68
Pfizer Inc.	1,52
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	1,41
AT&T Inc.	1,28

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Fonds obligations de sociétés Signature, Catégorie I</i>	%
Harvest Operations Corp.	0,82
Royal Bank of Scotland Group PLC	0,72
Credit Suisse Group AG	0,72
GMAC Capital Trust I	0,62
Lloyds Banking Group PLC	0,62

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Guardian Equity Income Fund, Série I</i>	%
Banque Toronto-Dominion	5,52
Banque de Nouvelle-Écosse	5,21
Banque Royale du Canada	4,66
TransCanada Corp.	4,58
Pembina Pipeline Corp.	4,40

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund</i>	%
Abertis Infraestructuras SA	8,38
Atlantia SpA	7,97
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	7,92
Vinci SA	7,74
Snam SpA	7,72

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT	
<i>Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund</i>	%
RPC Group Plc	1,86
TechnoPro Holdings Inc.	1,73
Aalberts Industries NV	1,66
Intertape Polymer Group Ltd	1,51
Innospec Inc.	1,50

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL SÉCURITAIRE BLACKROCK

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	17 328	17 758
Trésorerie	200	29
Cession de placements à recevoir	30	-
Autres débiteurs	-	22
Total de l'actif	17 558	17 809
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	90	-
Autres créditeurs	11	10
Total du passif	101	10
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	17 457	17 799
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,75	12,56
Classe B	12,57	12,43
Classe C	12,81	12,60
Classe E	12,80	12,59
Classe F	12,76	12,57
Classe G	12,71	12,53
Classe I	13,38	13,01
Classe J	13,38	13,00
Classe N	12,80	12,59

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL SÉCURITAIRE 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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	237	(56)
Non réalisé(e) sur les placements	1	393
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	58	55
Total gain net (perte nette)	296	392
Dividendes	59	64
Distributions par le fonds sous-jacent	180	179
	535	635
Charges		
Frais de gestion (note 6)	227	214
Frais d'administration	10	8
Frais de transactions	-	1
	237	223
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	298	412
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,20	0,29
Classe B	0,15	0,23
Classe C	0,22	0,30
Classe E	0,22	0,30
Classe F	0,21	0,29
Classe G	0,19	0,27
Classe I	0,40	0,53
Classe J	0,39	0,46
Classe N	0,22	0,30

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL SÉCURITAIRE 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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	17 799	17 182
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 915	1 664
Parts rachetées	(5 555)	(1 791)
	(640)	(127)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	298	412
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	17 457	17 467

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	298	412
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(238)	(337)
Distributions par le fonds sous-jacent	(238)	(234)
	(178)	(159)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 607)	(1 972)
Cessions	2 513	2 348
	906	376
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	83	1 127
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	811	1 344
Financement		
Parts émises	4 915	1 664
Parts rachetées	(5 555)	(1 791)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(640)	(127)
Variation nette de la trésorerie	171	1 217
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	29	(8)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	200	1 209
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	81	105

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL SÉCURITAIRE BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,26 %)				
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D	64,60	413 572	11 238	11 276
iShares Canadian Fundamental Index Fund	12,86	151 997	1 931	2 245
iShares US Fundamental Index Fund	7,90	41 935	871	1 380
iShares International Fundamental Index Fund	7,90	70 665	1 047	1 380
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D	6,00	81 688	884	1 047
TOTAL DES PLACEMENTS (99,26 %)			15 971	17 328
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,74 %)				129
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				17 457

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL SÉCURITAIRE BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental sécuritaire 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. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental sécuritaire BlackRock est un fonds distinct qui investit dans des unités de fonds afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (65 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions canadiennes (13 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares Canadian Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions étrangères (22 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares US Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management
iShares International Fundamental Index Fund (page 106)	
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D (page 106)	

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	5 005	-	-	5 005
Fonds de placement	12 323	-	-	12 323
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	17 328	-	-	17 328

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	5 086	-	-	5 086
Fonds de placement	12 672	-	-	12 672
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	17 758	-	-	17 758

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL ÉQUILIBRÉ BLACKROCK

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	40 866	44 637
Trésorerie	321	101
Cession de placements à recevoir	65	-
Autres débiteurs	10	100
Total de l'actif	41 262	44 838
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	130	-
Autres créditeurs	42	46
Total du passif	172	46
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 090	44 792
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,59	13,35
Classe B	13,44	13,25
Classe C	13,69	13,42
Classe E	13,70	13,42
Classe F	13,64	13,38
Classe G	13,53	13,31
Classe I	14,24	13,79
Classe J	14,32	13,87
Classe N	13,69	13,42

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL ÉQUILIBRÉ 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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 220	(293)
Non réalisé(e) sur les placements	(356)	1 096
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	120	90
Total gain net (perte nette)	984	893
Dividendes	251	284
Distributions par le fonds sous-jacent	319	295
	1 554	1 472
Charges		
Frais de gestion (note 6)	563	539
Frais d'administration	22	22
Frais de transactions	5	4
	590	565
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	964	907
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,28	0,24
Classe B	0,23	0,20
Classe C	0,31	0,27
Classe E	0,31	0,27
Classe F	0,29	0,25
Classe G	0,26	0,22
Classe I	0,49	0,41
Classe J	0,48	0,42
Classe N	0,31	0,26

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL ÉQUILIBRÉ 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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	44 792	45 915
Opérations sur les parts		
Parts émises	11 268	2 665
Parts rachetées	(15 934)	(5 066)
	(4 666)	(2 401)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	964	907
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	41 090	44 421

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	964	907
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(864)	(803)
Distributions par le fonds sous-jacent	(439)	(385)
	(339)	(281)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 500)	(6 758)
Cessions	7 574	9 384
	5 074	2 626
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	151	4 991
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	4 886	7 336
Financement		
Parts émises	11 268	2 665
Parts rachetées	(15 934)	(5 066)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(4 666)	(2 401)
Variation nette de la trésorerie	220	4 935
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	101	(94)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	321	4 841
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	349	472

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL ÉQUILIBRÉ BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,45 %)				
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D	39,92	601 607	16 230	16 403
iShares Canadian Fundamental Index Fund	21,84	607 602	7 585	8 974
iShares US Fundamental Index Fund	13,92	169 670	3 341	5 718
iShares International Fundamental Index Fund	13,82	290 808	4 066	5 680
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D	9,95	319 267	3 421	4 091
TOTAL DES PLACEMENTS (99,45 %)			34 643	40 866
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,55 %)				224
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				41 090

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL ÉQUILIBRÉ BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental équilibré 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. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental équilibré BlackRock est un fonds distinct qui investit dans des unités de fonds afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (40 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions canadiennes (22 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares Canadian Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions étrangères (38 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares US Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management
iShares International Fundamental Index Fund (page 106)	
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D (page 106)	

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	20 372	-	-	20 372
Fonds de placement	20 494	-	-	20 494
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	40 866	-	-	40 866

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	22 113	-	-	22 113
Fonds de placement	22 524	-	-	22 524
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	44 637	-	-	44 637

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL CROISSANCE BLACKROCK

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	20 315	23 307
Trésorerie	87	45
Cession de placements à recevoir	80	-
Autres débiteurs	20	63
Total de l'actif	20 502	23 415
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	26	32
Total du passif	26	32
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 476	23 383
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,93	13,70
Classe B	13,79	13,60
Classe C	14,05	13,77
Classe E	14,06	13,78
Classe F	13,97	13,72
Classe G	13,84	13,63
Classe I	14,58	14,15
Classe J	14,70	14,25
Classe N	14,04	13,77

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL CROISSANCE 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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	935	(132)
Non réalisé(e) sur les placements	(455)	512
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	54	34
Total gain net (perte nette)	534	414
Dividendes	154	173
Distributions par le fonds sous-jacent	133	110
	821	697
Charges		
Frais de gestion (note 6)	283	264
Frais d'administration	12	11
Frais de transactions	4	2
	299	277
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	522	420
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,29	0,21
Classe B	0,24	0,17
Classe C	0,33	0,24
Classe E	0,33	0,25
Classe F	0,31	0,23
Classe G	0,26	0,19
Classe I	0,51	0,39
Classe J	0,51	0,40
Classe N	0,33	0,24

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL CROISSANCE 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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	23 383	22 924
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 687	1 208
Parts rachetées	(8 116)	(2 201)
	(3 429)	(993)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	522	420
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	20 476	22 351

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	522	420
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(480)	(380)
Distributions par le fonds sous-jacent	(187)	(144)
	(145)	(104)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 328)	(3 456)
Cessions	4 987	4 532
	3 659	1 076
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(43)	2 508
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 471	3 480
Financement		
Parts émises	4 687	1 208
Parts rachetées	(8 116)	(2 201)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 429)	(993)
Variation nette de la trésorerie	42	2 487
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	45	24
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	87	2 511
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	216	286

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL CROISSANCE BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,21 %)				
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D	29,86	224 240	6 065	6 114
iShares Canadian Fundamental Index Fund	25,78	357 300	4 456	5 278
iShares US Fundamental Index Fund	16,84	102 324	2 019	3 448
iShares International Fundamental Index Fund	16,82	176 410	2 478	3 445
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D	9,91	158 462	1 698	2 030
TOTAL DES PLACEMENTS (99,21 %)			16 716	20 315
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,79 %)				161
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				20 476

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL CROISSANCE BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental croissance 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. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental croissance BlackRock est un fonds distinct qui investit exclusivement dans des unités de fonds afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (30 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions canadiennes (26 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares Canadian Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions étrangères (44 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares US Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management
iShares International Fundamental Index Fund (page 106)	
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D (page 106)	

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	12 171	-	-	12 171
Fonds de placement	8 144	-	-	8 144
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	20 315	-	-	20 315

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	13 876	-	-	13 876
Fonds de placement	9 431	-	-	9 431
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	23 307	-	-	23 307

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL AUDACIEUX BLACKROCK

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	14 465	17 047
Trésorerie	61	-
Cession de placements à recevoir	25	-
Autres débiteurs	-	53
Total de l'actif	14 551	17 100
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	18
Achat de placements à payer	25	-
Autres créditeurs	30	33
Total du passif	55	51
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	14 496	17 049
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,39	14,10
Classe B	14,21	13,98
Classe C	14,52	14,18
Classe E	14,51	14,18
Classe F	14,37	14,08
Classe G	14,20	13,97
Classe I	15,20	14,68
Classe J	15,20	14,68
Classe N	14,51	14,18

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL AUDACIEUX 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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	874	(111)
Non réalisé(e) sur les placements	(468)	349
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	36	16
Total gain net (perte nette)	442	254
Dividendes	125	142
Distributions par le fonds sous-jacent	78	52
	645	448
Charges		
Frais de gestion (note 6)	214	205
Frais d'administration	8	8
Frais de transactions	3	2
	225	215
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	420	233
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,34	0,17
Classe B	0,29	0,12
Classe C	0,39	0,20
Classe E	0,39	0,20
Classe F	0,34	0,16
Classe G	0,28	0,12
Classe I	0,58	0,35
Classe J	0,58	0,35
Classe N	0,38	0,20

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL AUDACIEUX 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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	17 049	16 382
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 331	1 293
Parts rachetées	(6 304)	(1 816)
	(2 973)	(523)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	420	233
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	14 496	16 092

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	420	233
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(406)	(238)
Distributions par le fonds sous-jacent	(114)	(68)
	(100)	(73)
Transactions de placements		
Acquisitions	(937)	(3 139)
Cessions	4 039	3 698
	3 102	559
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	50	2 218
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 052	2 704
Financement		
Parts émises	3 331	1 293
Parts rachetées	(6 304)	(1 816)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(2 973)	(523)
Variation nette de la trésorerie	79	2 181
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(18)	(10)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	61	2 171
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	178	233

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL AUDACIEUX BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,79 %)				
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D	19,99	106 270	2 887	2 898
iShares Canadian Fundamental Index Fund	27,98	274 582	3 395	4 056
iShares US Fundamental Index Fund	19,97	85 888	1 713	2 894
iShares International Fundamental Index Fund	19,90	147 736	2 040	2 885
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D	11,95	135 165	1 448	1 732
TOTAL DES PLACEMENTS (99,79 %)			11 483	14 465
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,21 %)				31
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				14 496

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE FONDAMENTAL AUDACIEUX BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental audacieux 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. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

Le Fonds SSQ Portefeuille fondamental audacieux BlackRock est un fonds distinct qui investit exclusivement dans des unités de fonds afin de respecter les cibles de répartition suivantes de la politique de placement :

Obligations (20 %)

Fonds	Gestionnaire
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions canadiennes (28 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares Canadian Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management

Actions étrangères (52 %)

Fonds	Gestionnaire
iShares US Fundamental Index Fund (page 106)	BlackRock Asset Management
iShares International Fundamental Index Fund (page 106)	
Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D (page 106)	

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	9 835	-	-	9 835
Fonds de placement	4 630	-	-	4 630
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	14 465	-	-	14 465

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	11 517	-	-	11 517
Fonds de placement	5 530	-	-	5 530
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	17 047	-	-	17 047

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLES FONDAMENTAUX

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

Au 30 juin 2017

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D</i>	%
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-03-2020	1,25
Gouvernement du Canada, 4,00 %, 01-06-2041	1,19
Gouvernement du Canada, 3,75 %, 01-06-2019	1,19
Gouvernement du Canada, 5,00 %, 01-06-2037	1,15
Gouvernement du Canada, 3,50 %, 01-12-2045	1,11

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock CAD indiciel marchés émergents MSCI, Classe D</i>	%
Tencent Holdings Ltd	4,36
Samsung Electronics Co. Ltd	4,35
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	3,62
Alibaba Group Holding Ltd	3,41
Naspers Ltd.	1,82

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>iShares Canadian Fundamental Index Fund</i>	%
Banque Royale du Canada	8,02
Banque Toronto-Dominion	6,99
Banque de Nouvelle-Écosse	6,21
Suncor Energy Inc.	4,45
Banque de Montréal	4,34

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>iShares US Fundamental Index Fund</i>	%
Exxon Mobil Corp.	2,78
Apple Inc.	2,14
Chevron Corp.	1,83
JPMorgan Chase & Co.	1,82
AT&T Inc.	1,71

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>iShares International Fundamental Index Fund</i>	%
HSBC Holdings PLC	1,54
BP PLC	1,52
Banco Santander SA	1,41
Royal Dutch Shell PLC, Catégorie A	1,25
Total SA	1,22

FONDS SSQ ÉQUILIBRÉ POWER DYNAMIQUE

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	7 526	11 594
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	35	-
Autres débiteurs	-	2
Total de l'actif	7 561	11 596
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	27	13
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	10	23
Total du passif	37	36
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	7 524	11 560
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,69	11,81
Classe B	11,50	11,68
Classe C	11,78	11,88
Classe E	11,79	11,88
Classe F	11,67	11,80
Classe G	11,51	11,68
Classe I	12,44	12,33
Classe J	12,54	12,43
Classe N	11,78	11,88

FONDS SSQ ÉQUILBRÉ POWER DYNAMIQUE

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	490	98
Non réalisé(e) sur les placements	(368)	(660)
Total gain net (perte nette)	122	(562)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	122	(562)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	171	235
Frais d'administration	5	7
Frais de transactions	-	-
	176	242
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(54)	(804)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,08)	(0,69)
Classe B	(0,13)	(0,74)
Classe C	(0,05)	(0,66)
Classe E	(0,05)	(0,66)
Classe F	(0,08)	(0,69)
Classe G	(0,13)	(0,74)
Classe I	0,15	(0,47)
Classe J	0,15	(0,49)
Classe N	(0,05)	(0,66)

FONDS SSQ ÉQUILBRÉ POWER DYNAMIQUE

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	11 560	14 864
Opérations sur les parts		
Parts émises	535	617
Parts rachetées	(4 517)	(1 683)
	(3 982)	(1 066)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(54)	(804)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	7 524	12 994

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(54)	(804)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(122)	562
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(176)	(242)
Transactions de placements		
Acquisitions	-	-
Cessions	4 190	1 340
	4 190	1 340
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(46)	240
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 968	1 338
Financement		
Parts émises	535	617
Parts rachetées	(4 517)	(1 683)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 982)	(1 066)
Variation nette de la trésorerie	(14)	272
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(13)	(223)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(27)	49
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ÉQUILIBRÉ POWER DYNAMIQUE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,03 %)			
Fonds équilibré Power Dynamique, Série OP	589 326	6 679	7 526
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,03 %)			(2)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			7 524

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds équilibré Power Dynamique, Série OP</i>	%
Catégorie croissance US Power Dynamique, Série E	14,39
Gouvernement du Canada, Bon du Trésor, 0,78 %, 30-11-2017	4,28
Gouvernement du Canada, Bon du Trésor, 0,68 %, 21-09-2017	4,26
Contrat à terme obligations canadiennes 10 ans, septembre 2017	3,48
Gouvernement du Canada, 5,75 %, 01-06-2029	2,65
CIBC	2,27
Gouvernement du Canada, 0,75 %, 01-05-2019	2,16
Banque de Montréal	1,83
Shaw Communications Inc., catégorie B	1,70
Banque Toronto-Dominion	1,69

FONDS SSQ ÉQUILIBRÉ POWER DYNAMIQUE

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Équilibré Power Dynamique est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent équilibré Power Dynamique, Série OP. Par conséquent, le Fonds SSQ Équilibré Power Dynamique 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 Fonds Dynamique selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie du gestionnaire est d'investir dans un portefeuille diversifié d'actions et de titres à revenu fixe. L'actif du fonds de ces deux composantes peut varier de 40 % à 60 %. Pour la portion des actions, il utilise l'analyse fondamentale pour évaluer le potentiel de croissance des titres. L'évaluation de la situation financière et la gestion de chaque société, son secteur et l'économie dans son ensemble sont analysés.

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	7 526	-	-	7 526
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	7 526	-	-	7 526

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	11 594	-	-	11 594
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	11 594	-	-	11 594

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ REVENU MENSUEL 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	16 789	12 828
Trésorerie	218	73
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	6
Total de l'actif	17 007	12 907
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	155	-
Autres créditeurs	2	1
Total du passif	157	1
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	16 850	12 906
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,78	9,76
Classe B	9,59	9,63
Classe C	9,83	9,79
Classe E	9,83	9,80
Classe F	9,79	9,77
Classe G	9,74	9,73
Classe I	10,31	10,13
Classe J	11,00	10,61
Classe L	11,19	10,80
Classe N	9,83	9,80

FONDS SSQ REVENU MENSUEL 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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	17	(6)
Non réalisé(e) sur les placements	494	314
Total gain net (perte nette)	511	308
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	511	308
Charges		
Frais de gestion (note 6)	204	89
Frais d'administration	8	3
Frais de transactions	-	-
	212	92
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	299	216
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,18	0,31
Classe B	0,12	0,25
Classe C	0,19	0,33
Classe E	0,20	0,33
Classe F	0,18	0,31
Classe G	0,17	0,30
Classe I	0,35	0,47
Classe J	0,37	0,47
Classe L	0,37	0,48
Classe N	0,19	0,33

FONDS SSQ REVENU MENSUEL 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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	12 906	3 732
Opérations sur les parts		
Parts émises	7 262	7 114
Parts rachetées	(3 341)	(1 409)
	3 921	5 705
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(276)	(128)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	299	216
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	16 850	9 525

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	299	216
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(511)	(308)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(212)	(92)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 760)	(5 715)
Cessions	310	245
	(3 450)	(5 470)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	162	77
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(3 500)	(5 485)
Financement		
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(276)	(128)
Parts émises	7 262	7 114
Parts rachetées	(3 341)	(1 409)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	3 645	5 577
Variation nette de la trésorerie	145	92
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	73	23
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	218	115
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU MENSUEL SÉCURITAIRE GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,64 %)			
Guardian Managed Yield Portfolio, Série I	1 585 370	16 065	16 789
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,36 %)			61
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			16 850

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Guardian Managed Yield Portfolio, Série I</i>	%
Fonds d'obligations canadiennes Guardian, Série I	29,50
Fonds d'actions mondiales dividendes Guardian, Série I	12,70
Fonds d'obligations à court terme Guardian, Série I	12,30
Fonds de revenu d'actions Guardian, Série I	11,80
Fonds d'actions mondiales fondamentales Guardian, Série I	10,50
Fonds d'obligations à haut rendement Guardian, Série I	10,00
Fonds d'actions canadiennes Guardian, Série I	9,30
Fonds d'actions canadiennes concentré Guardian, Série I	2,30
Fonds d'actions marchés émergents Guardian, Série I	1,60

FONDS SSQ REVENU MENSUEL SÉCURITAIRE GUARDIAN

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu mensuel sécuritaire Guardian est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Guardian Managed Yield Portfolio, Serie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu mensuel 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 stratégiques et tactiques qui donnent la possibilité à celui-ci de profiter des opportunités de marché à mesure qu'ils 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	16 789	-	-	16 789
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	16 789	-	-	16 789

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	12 828	-	-	12 828
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	12 828	-	-	12 828

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ REVENU MENSUEL 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	27 805	16 908
Trésorerie	386	99
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	20	3
Total de l'actif	28 211	17 010
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	350	210
Autres créditeurs	16	6
Total du passif	366	216
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 845	16 794
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,91	9,86
Classe B	9,73	9,74
Classe C	9,99	9,92
Classe E	10,00	9,92
Classe F	9,93	9,88
Classe G	9,85	9,82
Classe I	10,49	10,25
Classe J	11,20	10,77
Classe L	11,42	10,98
Classe N	10,08	10,01

FONDS SSQ REVENU MENSUEL 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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	6	-
Non réalisé(e) sur les placements	746	407
Total gain net (perte nette)	752	407
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	752	407
Charges		
Frais de gestion (note 6)	320	112
Frais d'administration	11	4
Frais de transactions	-	-
	331	116
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	421	291
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,16	0,34
Classe B	0,11	0,28
Classe C	0,19	0,37
Classe E	0,19	0,36
Classe F	0,17	0,34
Classe G	0,14	0,31
Classe I	0,34	0,50
Classe J	0,36	0,50
Classe L	0,37	0,69
Classe N	0,19	0,37

FONDS SSQ REVENU MENSUEL 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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	16 794	4 645
Opérations sur les parts		
Parts émises	15 797	7 512
Parts rachetées	(4 750)	(1 225)
	11 047	6 287
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(417)	(158)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	421	291
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	27 845	11 065

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	421	291
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(752)	(407)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(331)	(116)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 310)	(5 620)
Cessions	165	-
	(10 145)	(5 620)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	133	(431)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(10 343)	(6 167)
Financement		
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(417)	(158)
Parts émises	15 797	7 512
Parts rachetées	(4 750)	(1 225)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	10 630	6 129
Variation nette de la trésorerie	287	(38)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	99	84
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	386	46
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU MENSUEL GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,86 %)			
Guardian Managed Income & Growth Portfolio, Série I	2 571 653	<u>26 498</u>	<u>27 805</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,14 %)			<u>40</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>27 845</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Guardian Managed Income & Growth Portfolio, Série I</i>	%
Fonds d'actions mondiales dividendes Guardian, Série I	19,80
Fonds de revenu d'actions Guardian, Série I	17,90
Fonds d'obligations à haut rendement Guardian, Série I	15,70
Fonds d'obligations canadiennes Guardian, Série I	15,60
Fonds d'actions mondiales fondamentales Guardian, Série I	11,40
Fonds d'actions canadiennes Guardian, Série I	10,50
Fonds d'obligations à court terme Guardian, Série I	3,60
Fonds d'actions canadiennes concentré Guardian, Série I	3,00
Fonds d'actions marchés émergents, Série I	2,50

FONDS SSQ REVENU MENSUEL GUARDIAN

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu mensuel Guardian est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Guardian Managed Income & Growth Portfolio, Serie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu mensuel 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 stratégiques et tactiques qui donnent la possibilité à celui-ci de profiter des opportunités de marché à mesure qu'ils 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	27 805	-	-	27 805
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	27 805	-	-	27 805

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	16 908	-	-	16 908
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	16 908	-	-	16 908

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	142 144	149 877
Trésorerie	279	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	15	4
Total de l'actif	142 438	149 881
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	2
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	140	154
Total du passif	140	156
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	142 298	149 725
Valeur liquidative, par part		
Classe A	7,70	7,81
Classe B	7,62	7,76
Classe C	7,76	7,86
Classe E	7,77	7,86
Classe F	7,69	7,80
Classe G	7,59	7,73
Classe I	8,14	8,12
Classe J	8,71	8,53
Classe L	12,51	12,25
Classe N	7,76	7,86

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 212	18
Non réalisé(e) sur les placements	(5 480)	(2 778)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	654	5 746
Total gain net (perte nette)	(3 614)	2 986
Intérêts aux fins d'attribution	1	1
Distributions par le fonds sous-jacent	6 946	591
	3 333	3 578
Charges		
Frais de gestion (note 6)	2 180	1 994
Frais d'administration	71	65
Frais de transactions	-	-
	2 251	2 059
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 082	1 519
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,04	0,08
Classe B	0,02	0,06
Classe C	0,06	0,10
Classe E	0,07	0,10
Classe F	0,04	0,08
Classe G	0,01	0,05
Classe I	0,18	0,21
Classe J	0,18	0,22
Classe L	0,28	0,31
Classe N	0,06	0,10

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	149 725	131 357
Opérations sur les parts		
Parts émises	33 511	19 706
Parts rachetées	(39 294)	(13 453)
	(5 783)	6 253
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 726)	(2 600)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 082	1 519
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	142 298	136 529

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 082	1 519
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	4 268	2 760
Distributions par le fonds sous-jacent	(7 600)	(6 337)
	(2 250)	(2 058)
Transactions de placements		
Acquisitions	(5 285)	(2 910)
Cessions	16 350	1 065
	11 065	(1 845)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(25)	(351)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	8 790	(4 254)
Financement		
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 726)	(2 600)
Parts émises	33 511	19 706
Parts rachetées	(39 294)	(13 453)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(8 509)	3 653
Variation nette de la trésorerie	281	(601)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(2)	1 120
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	279	519
Intérêts reçus	1	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,89 %)			
Catégorie de société canadienne de répartition de l'actif Cambridge, Catégorie O	9 194 305	<u>134 045</u>	<u>142 144</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,11 %)			<u>154</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>142 298</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

Catégorie de société canadienne de répartition de l'actif Cambridge,

Catégorie O %

Cambridge Bond Fund	27,39
Cambridge Canadian Short Term Bond Fund	14,14
Walgreens Boots Alliance Inc.	3,09
Tourmaline Oil Corp.	2,98
Franco-Nevada Corp.	2,85
George Weston Ltd.	2,76
Canadian Natural Resources Ltd.	2,57
Athene Holding Ltd.	2,07
Fairfax Financial Holdings Ltd.	2,06
Praxair Inc.	<u>2,04</u>

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Catégorie de société canadienne de répartition de l'actif Cambridge, Catégorie O. Par conséquent, le Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge 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 Placements 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	142 144	-	-	142 144
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	142 144	-	-	142 144

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	149 877	-	-	149 877
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	149 877	-	-	149 877

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	115 899	112 040
Trésorerie	1 034	-
Cession de placements à recevoir	-	195
Autres débiteurs	18	1
Total de l'actif	116 951	112 236
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	277
Achat de placements à payer	860	-
Autres créditeurs	49	79
Total du passif	909	356
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	116 042	111 880
Valeur liquidative, par part		
Classe A	6,35	6,35
Classe B	6,27	6,29
Classe C	6,41	6,38
Classe E	6,41	6,39
Classe F	6,34	6,34
Classe G	6,26	6,28
Classe I	6,77	6,63
Classe J	7,35	7,04
Classe L	13,35	12,79
Classe N	6,41	6,38

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	590	(62)
Non réalisé(e) sur les placements	1 146	(7 126)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1 863	1 730
Total gain net (perte nette)	3 599	(5 458)
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	1 150	1 085
	4 750	(4 373)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 754	1 596
Frais d'administration	51	46
Frais de transactions	-	-
	1 805	1 642
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 945	(6 015)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,15	(0,39)
Classe B	0,13	(0,41)
Classe C	0,17	(0,38)
Classe E	0,17	(0,37)
Classe F	0,15	(0,39)
Classe G	0,12	(0,41)
Classe I	0,29	(0,28)
Classe J	0,31	(0,29)
Classe L	0,55	(0,52)
Classe N	0,17	(0,38)

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	111 880	92 071
Opérations sur les parts		
Parts émises	32 354	32 066
Parts rachetées	(28 737)	(13 383)
	3 617	18 683
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 400)	(2 315)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 945	(6 015)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	116 042	102 424

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 945	(6 015)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 736)	7 188
Distributions par le fonds sous-jacent	(3 013)	(2 815)
	(1 804)	(1 642)
Transactions de placements		
Acquisitions	(6 860)	(16 520)
Cessions	7 750	1 410
	890	(15 110)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1 008	(603)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	94	(17 355)
Financement		
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 400)	(2 315)
Parts émises	32 354	32 066
Parts rachetées	(28 737)	(13 383)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	1 217	16 368
Variation nette de la trésorerie	1 311	(987)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(277)	1 470
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	1 034	483
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,88 %)			
Fonds mondial de croissance et de revenu Signature, Catégorie I	12 303 491	108 359	115 899
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,12 %)			143
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			116 042

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds mondial de croissance et de revenu Signature, Catégorie I</i>	%
Synchrony Financial	2,99
Citigroup Inc.	2,75
Wells Fargo & Co.	2,16
Alibaba Group Holding Ltd.	2,10
Micron Technology Inc.	1,68
Sony Corp.	1,53
Titre du trésor des États-Unis, 0,88 %, 19-06-2019	1,41
Apple Inc.	1,35
Samsung Electronics Co Ltd.	1,27
UnitedHealth Group Inc.	1,16

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI Signature est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent mondial de croissance et de revenu Signature, Catégorie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI Signature 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 Placements 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	115 899	-	-	115 899
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	115 899	-	-	115 899

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	112 040	-	-	112 040
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	112 040	-	-	112 040

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	84 019	75 358
Trésorerie	588	371
Cession de placements à recevoir	-	140
Autres débiteurs	-	15
Total de l'actif	84 607	75 884
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	150	470
Autres créditeurs	8	17
Total du passif	158	487
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	84 449	75 397
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,55	13,68
Classe B	13,35	13,54
Classe E	13,67	13,77
Classe F	13,49	13,64
Classe G	13,33	13,53
Classe I	14,27	14,19
Classe J	14,27	14,19
Classe L	11,87	11,80
Classe N	13,66	13,76

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	349	1
Non réalisé(e) sur les placements	(1 314)	5 905
Total gain net (perte nette)	(965)	5 906
Distributions par le fonds sous-jacent	1 321	952
	356	6 858
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 270	864
Frais d'administration	36	25
Frais de transactions	-	-
	1 306	889
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(950)	5 969
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,16)	1,32
Classe B	(0,21)	1,25
Classe E	(0,12)	1,35
Classe F	(0,17)	1,30
Classe G	(0,22)	1,26
Classe I	0,06	1,52
Classe J	0,06	1,52
Classe L	0,05	1,32
Classe N	(0,12)	1,35

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	75 397	48 990
Opérations sur les parts		
Parts émises	26 866	22 037
Parts rachetées	(16 864)	(13 074)
	10 002	8 963
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(950)	5 969
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	84 449	63 922

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(950)	5 969
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	965	(5 906)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 321)	(952)
	(1 306)	(889)
Transactions de placements		
Acquisitions	(11 665)	(8 995)
Cessions	3 360	1 095
	(8 305)	(7 900)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(174)	12
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(9 785)	(8 777)
Financement		
Parts émises	26 866	22 037
Parts rachetées	(16 864)	(13 074)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	10 002	8 963
Variation nette de la trésorerie	217	186
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	371	15
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	588	201
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,49 %)			
Guardian Equity Income Fund, Serie I	4 522 030	76 770	84 019
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,51 %)			430
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			84 449

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Guardian Equity Income Fund, Serie I</i>	%
Banque Toronto-Dominion	5,52
Banque de Nouvelle-Écosse	5,21
Banque Royale du Canada	4,66
TransCanada Corp.	4,58
Pembina Pipeline Corp.	4,40
Enbridge Inc.	4,02
Société Financière Manuvie	3,83
CIBC	3,63
Agrium Inc.	3,54
Keyera Corp.	3,25

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	84 019	-	-	84 019
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	84 019	-	-	84 019

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	75 358	-	-	75 358
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	75 358	-	-	75 358

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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		
Aux	30 juin 2017	31 décembre 2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	177 232	177 886
Trésorerie	159	564
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	177 391	178 450
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	45	50
Total du passif	45	50
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	177 346	178 400
Valeur liquidative, par part		
Classe A	23,92	24,33
Classe B	23,50	24,03
Classe D	23,50	24,03
Classe E	24,13	24,48
Classe F	23,82	24,26
Classe G	23,52	24,05
Classe H	23,15	23,78
Classe I	25,26	25,28
Classe J	25,26	25,28
Classe N	24,12	24,47

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	257	(424)
Non réalisé(e) sur les placements	(2 531)	8 963
Total gain net (perte nette)	(2 274)	8 539
Intérêts aux fins d'attribution	1	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 095	2 288
	(178)	10 828
Charges		
Frais de gestion (note 6)	1 556	1 388
Frais d'administration	43	38
Frais de transactions	-	-
	1 599	1 426
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 777)	9 402
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,43)	1,01
Classe B	(0,55)	0,89
Classe D	(0,55)	0,89
Classe E	(0,37)	1,07
Classe F	(0,46)	0,99
Classe G	(0,54)	0,89
Classe H	(0,65)	0,79
Classe I	(0,03)	1,38
Classe J	(0,03)	1,38
Classe N	(0,37)	1,06

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	178 400	166 795
Opérations sur les parts		
Parts émises	26 660	20 008
Parts rachetées	(25 937)	(19 890)
	723	118
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 777)	9 402
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	177 346	176 315

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 777)	9 402
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 274	(8 539)
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 095)	(2 288)
	(1 598)	(1 425)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 835)	(5 055)
Cessions	11 310	7 080
	475	2 025
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(5)	(7)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(1 128)	593
Financement		
Parts émises	26 660	20 008
Parts rachetées	(25 937)	(19 890)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	723	118
Variation nette de la trésorerie	(405)	711
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	564	(298)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	159	413
Intérêts reçus	1	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,94 %)			
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	5 510 869	175 695	177 232
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,06 %)			114
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			177 346

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser</i>	%
Banque Toronto-Dominion	8,36
Banque Royale du Canada	7,06
Fonds d'actions spéciales Jarislowsky Fraser	6,70
Banque de Nouvelle-Écosse	6,48
Enbridge Inc.	5,66
Chemins de fer nationaux du Canada	5,25
Canadian Natural Resources Ltd.	4,08
Société Financière Manuvie	4,01
Alimentation Couche-Tard Inc., Catégorie B	3,36
Open Text Corp.	3,34

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	177 232	-	-	177 232
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	177 232	-	-	177 232

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	177 886	-	-	177 886
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	177 886	-	-	177 886

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	261 953	266 684
Trésorerie	2 111	2 329
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	534	538
Total de l'actif	264 598	269 551
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	59	65
Total du passif	59	65
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	264 539	269 486
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,53	15,58
Classe B	15,28	15,41
Classe D	15,26	15,39
Classe E	15,66	15,67
Classe F	15,48	15,54
Classe G	15,27	15,40
Classe H	15,03	15,23
Classe I	16,40	16,19
Classe J	16,40	16,19
Classe K	16,40	16,19
Classe N	15,66	15,67

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	4 129	17 255
Non réalisé(e) sur les placements	(2 869)	(7 672)
Total gain net (perte nette)	1 260	9 583
Intérêts aux fins d'attribution	12	51
Prêts de titres	30	136
Dividendes	2 891	2 154
Écart de conversion sur la trésorerie	(42)	5
	4 151	11 929
Charges		
Retenues d'impôts	52	19
Frais de gestion (note 6)	696	704
Frais d'administration	20	21
Frais de transactions	377	357
	1 145	1 101
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 006	10 828
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,04)	0,50
Classe B	(0,12)	0,43
Classe D	(0,13)	0,42
Classe E	-	0,54
Classe F	(0,06)	0,49
Classe G	(0,12)	0,43
Classe H	(0,20)	0,36
Classe I	0,23	0,75
Classe J	0,23	0,75
Classe K	0,23	0,75
Classe N	-	0,54

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	269 486	224 734
Opérations sur les parts		
Parts émises	22 814	33 047
Parts rachetées	(30 767)	(18 601)
	(7 953)	14 446
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 006	10 828
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	264 539	250 008

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 006	10 828
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	42	(5)
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 266)	(9 287)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	1 782	1 536
Transactions de placements		
Acquisitions	(145 260)	(154 812)
Cessions	151 257	140 343
	5 997	(14 469)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2)	(4 061)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	7 777	(16 994)
Financement		
Parts émises	22 814	33 047
Parts rachetées	(30 767)	(18 601)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(7 953)	14 446
Écart de conversion sur la trésorerie	(42)	5
Variation nette de la trésorerie	(218)	(2 543)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	2 329	3 287
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	2 111	744
Intérêts reçus	59	203
Dividendes reçus	2 842	1 923

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur		Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
ACTIONS CANADIENNES (90,88 %)				ACTIONS CANADIENNES (90,88 %) (suite)			
Énergie (13,56 %)				Services financiers (31,88 %) (suite)			
Advantage Oil & Gas Ltd.	300 000	2 501	2 631	Onex Corp.	63 000	5 427	6 540
Cameco Corp.	90 000	1 335	1 063	Société Financière Manuvie	112 000	2 751	2 723
Canadian Natural Resources Ltd.	72 000	2 706	2 694	TMX Group Ltd.	83 000	5 169	5 856
Encana Corp.	477 000	7 127	5 443	Trisura Group Ltd.	471	8	10
Enerflex Ltd.	151 000	3 058	2 842			<u>73 482</u>	<u>84 340</u>
Gibson Energy Inc.	70 000	1 352	1 173				
NexGen Energy Ltd.	460 000	1 542	1 320	Télécommunications (1,55 %)			
Parex Resources Inc.	320 000	3 337	4 720	Rogers Communications Inc., Catégorie B NV	67 000	<u>3 421</u>	<u>4 104</u>
Parkland Fuel Corp.	103 192	2 653	3 066				
PrairieSky Royalty Ltd.	2 500	63	74	Technologies de l'information (9,28 %)			
Suncor Energy Inc.	100 000	4 309	3 789	Celestica Inc.	150 000	2 738	2 643
TransCanada Corp.	114 000	<u>6 185</u>	<u>7 047</u>	Kinaxis Inc.	55 000	1 902	4 441
		<u>36 168</u>	<u>35 862</u>	Open Text Corp.	183 000	7 203	7 490
				Shopify Inc., Catégorie A	66 000	4 258	7 432
Matériaux de base (11,04 %)				Sierra Wireless Inc.	70 000	<u>2 832</u>	<u>2 549</u>
CCL Industries Inc., Catégorie B NV	80 000	5 034	5 249			<u>18 933</u>	<u>24 555</u>
First Quantum Minerals Ltd.	230 000	3 076	2 523	Immobilier (3,46 %)			
Franco-Nevada Corp.	18 500	1 586	1 731	Canadian Apartment Properties REIT	70 000	2 033	2 350
Guyana Goldfields Inc.	207 000	1 099	1 259	Canadian REIT	52 000	2 332	2 385
Ivanhoe Mines Ltd., Classe A	300 000	1 355	1 251	FirstService Corp.	53 000	<u>4 115</u>	<u>4 410</u>
Labrador Iron Ore	75 000	1 424	1 179			<u>8 480</u>	<u>9 145</u>
Lundin Mining Corp.	550 000	4 231	4 054	TOTAL ACTIONS CANADIENNES		<u>214 099</u>	<u>240 425</u>
Methanex Corp.	24 000	1 456	1 374				
Norbord Inc.	100 000	3 912	4 037	ACTIONS AMÉRICAINES (4,79 %)			
Potash Corporation of Saskatchewan Inc.	110 000	2 766	2 327	Produits industriels (1,32 %)			
Teck Resources Ltd., Catégorie B	65 000	639	1 461	Caterpillar Inc.	25 000	<u>2 640</u>	<u>3 488</u>
West Fraser Timber Co. Ltd.	45 000	<u>2 628</u>	<u>2 762</u>				
		<u>29 206</u>	<u>29 207</u>	Services financiers (1,98 %)			
				Discover Financial Services	30 000	2 802	2 422
Produits industriels (11,59 %)				Legg Mason Inc.	57 000	<u>2 864</u>	<u>2 824</u>
Air Canada	200 000	2 637	3 476			<u>5 666</u>	<u>5 246</u>
Bombardier Inc., Catégorie B	1 070 000	2 752	2 525	Technologies de l'information (1,49 %)			
Chemins de fer nationaux du Canada	95 000	8 770	9 996	NVIDIA Corp.	21 000	<u>2 593</u>	<u>3 941</u>
Finning International Inc.	50 000	1 129	1 271	TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES		<u>10 899</u>	<u>12 675</u>
Groupe SNC-Lavalin Inc.	90 000	4 906	5 046				
Savaria Corp.	180 000	2 192	2 869	ACTIONS INTERNATIONALES (3,35 %)			
Wajax	120 000	2 926	2 717	Produits industriels (1,03 %)			
Waste Connections Inc.	33 000	<u>2 749</u>	<u>2 756</u>	ABB Ltd.	85 000	<u>2 484</u>	<u>2 729</u>
		<u>28 061</u>	<u>30 656</u>				
Consommation discrétionnaire (4,67 %)				Consommation discrétionnaire (1,03 %)			
Dollarama Inc.	67 000	6 454	8 302	Garmin Ltd.	41 000	<u>2 531</u>	<u>2 716</u>
Restaurant Brands International Inc.	50 000	<u>4 058</u>	<u>4 057</u>				
		<u>10 512</u>	<u>12 359</u>	Technologies de l'information (1,29 %)			
				Tencent Holdings Ltd.	73 000	<u>2 563</u>	<u>3 408</u>
Consommation de base (3,85 %)				TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		<u>7 578</u>	<u>8 853</u>
Premium Brands Holdings Corp.	83 000	3 374	7 722				
Saputo Inc.	60 000	<u>2 462</u>	<u>2 475</u>	TOTAL DES PLACEMENTS (99,02 %)		<u>232 576</u>	<u>261 953</u>
		<u>5 836</u>	<u>10 197</u>				
Services financiers (31,88 %)				AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,98 %)			<u>2 586</u>
AGF Management Ltd., Catégorie B	430 000	2 743	2 898	TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>264 539</u>
Banque de Montréal	107 000	8 550	10 189				
Banque de Nouvelle-Écosse	179 000	12 700	13 964				
Banque Royale du Canada	155 000	11 712	14 595				
Banque Toronto-Dominion	295 000	16 978	19 278				
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	80 000	3 351	4 071				
CIBC	40 000	4 093	4 216				

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017 et au 31 décembre 2016, l'actif du Fonds est composé principalement de titres 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 2017 et au 31 décembre 2016, l'exposition du Fonds au risque de crédit se limite à la détention de titres de marché monétaire. Par conséquent, le risque de crédit n'a pas d'impact significatif sur le Fonds.

Le Fonds peut participer à des opérations de prêts de titres. Au 30 juin 2017, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 79 565 \$ (91 205 \$ au 31 décembre 2016) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 85 135 \$ (97 297 \$ au 31 décembre 2016).

De plus, au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	59	-	59

31 décembre 2016	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	65	-	65

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016 le Fonds est exposé au risque de taux d'intérêt puisqu'il détient des placements à revenu fixe portant intérêt. Toutefois, puisqu'il détient des placements échéant à très court terme, une variation de 1 % des taux d'intérêt aurait un impact négligeable sur le Fonds.

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 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 canadiennes à grande capitalisation serait :

Variation (%)	30 juin 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+ 5	12 021	11 010
- 5	(12 021)	(11 010)

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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 (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 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Actions canadiennes		
Énergie	13,56	18,36
Matériaux de base	11,04	10,56
Produits industriels	11,59	7,09
Consommation discrétionnaire	4,67	1,49
Consommation de base	3,85	6,61
Services financiers	31,88	24,96
Télécommunications	1,55	2,62
Technologies de l'information	9,28	6,19
Services	-	1,24
Immobilier	3,46	2,59
Actions américaines		
Produits industriels	1,32	1,15
Consommation discrétionnaire	-	0,99
Consommation de base	-	1,89
Soins de santé	-	0,98
Services financiers	1,98	-
Technologies de l'information	1,49	2,17
Actions internationales		
Produits industriels	1,03	0,90
Consommation discrétionnaire	1,03	-
Technologies de l'information	1,29	0,88
Marché monétaire		
	-	8,29
Autres éléments d'actif net		
	0,98	1,04
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 :

30 juin 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	261 953	-	-	261 953
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	261 953	-	-	261 953

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	244 345	-	-	244 345
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	22 339	-	22 339
Total	244 345	22 339	-	266 684

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES MONTRUSCO BOLTON

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	62 208	59 881
Trésorerie	-	283
Cession de placements à recevoir	374	-
Autres débiteurs	141	98
Total de l'actif	62 723	60 262
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	395	-
Achat de placements à payer	256	33
Autres créditeurs	8	9
Total du passif	659	42
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	62 064	60 220
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,82	11,11
Classe B	10,55	10,92
Classe E	10,91	11,18
Classe F	10,77	11,08
Classe G	10,63	10,97
Classe I	11,47	11,57
Classe J	11,47	11,57
Classe K	11,47	11,57
Classe N	10,91	11,18

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES MONTRUSCO BOLTON

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 328	45
Non réalisé(e) sur les placements	(2 452)	5 535
Total gain net (perte nette)	(1 124)	5 580
Intérêts aux fins d'attribution	2	2
Prêts de titres	46	29
Dividendes	532	653
	(544)	6 264
Charges		
Frais de gestion (note 6)	42	14
Frais d'administration	1	-
Frais de transactions	30	58
	73	72
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(617)	6 192
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,30)	0,68
Classe B	(0,38)	0,61
Classe E	(0,27)	0,72
Classe F	(0,31)	0,67
Classe G	(0,35)	0,63
Classe I	(0,11)	0,86
Classe J	(0,11)	0,86
Classe K	(0,11)	0,86
Classe N	(0,27)	0,71

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES MONTRUSCO BOLTON

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	60 220	77 179
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 004	3 265
Parts rachetées	(3 543)	(22 711)
	2 461	(19 446)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(617)	6 192
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	62 064	63 925

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(617)	6 192
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	1 124	(5 580)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	507	612
Transactions de placements		
Acquisitions	(25 683)	(24 690)
Cessions	22 232	45 681
	(3 451)	20 991
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(195)	(3 626)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(3 139)	17 977
Financement		
Parts émises	6 004	3 265
Parts rachetées	(3 543)	(22 711)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	2 461	(19 446)
Variation nette de la trésorerie	(678)	(1 469)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	283	2 163
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(395)	694
Intérêts reçus	48	32
Dividendes reçus	489	651

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES MONTRUSCO BOLTON

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, sauf le nombre d'actions et de parts)

	Valeur nominale	Coût moyen	Juste valeur		Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
MARCHÉ MONÉTAIRE (0,44 %)				ACTIONS CANADIENNES (80,60 %) (suite)			
Gouvernement du Canada Bon du Trésor, 0,55 %, 05-10-2017	275	275	275	Services financiers (27,22 %) (suite)			
TOTAL MARCHÉ MONÉTAIRE		275	275	Thomson Reuters Corp.	19 885	1 212	1 194
						14 974	16 895
				Télécommunications (1,13 %)			
ACTIONS CANADIENNES (80,60 %)				TELUS Corp.	15 628	638	700
Énergie (13,81 %)				Technologies de l'information (5,19 %)			
Advantage Oil & Gas Ltd.	112 701	855	988	CGI Group Inc., Catégorie A	30 553	1 777	2 024
Bonterra Energy Corp.	35 124	1 002	588	Kinaxis Inc.	8 846	490	714
CES Energy Solutions Corp.	52 078	264	301	Shopify Inc., Catégorie A	4 308	360	485
Imperial Oil Ltd.	48 500	2 105	1 833			2 627	3 223
Parex Resources Inc.	169 571	1 913	2 501	Immobilier (1,82 %)			
Pembina Pipeline Corp.	54 922	1 996	2 359	Altus Group Ltd.	18 955	564	531
		8 135	8 570	FirstService Corp.	7 157	442	596
						1 006	1 127
Matériaux de base (10,70 %)				TOTAL ACTIONS CANADIENNES		43 971	50 025
Agrium Inc.	14 474	1 732	1 701				
CCL Industries Inc., Catégorie B NV	18 817	764	1 235	Nombre	Coût	Juste	
Fortuna Silver Mines Inc.	214 810	1 329	1 364	de parts	moyen	valeur	
Osisko Gold Royalties Ltd.	51 208	800	812		\$	\$	
Stella-Jones Inc.	19 716	883	873	FONDS DE PLACEMENT (19,19 %)			
Winpak Ltd.	11 284	506	657	Quantitatif d'actions canadiennes Montrusco Bolton	347 732	12 481	11 908
		6 014	6 642				
Produits industriels (9,13 %)				TOTAL DES PLACEMENTS (100,23 %)		56 727	62 208
Badger Daylighting Ltd.	4 667	138	124	AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU			
Boyd Group Income Fund	4 137	344	398	POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,23 %)			(144)
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	9 466	1 705	1 975	TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE			
Chemins de fer nationaux du Canada	5 960	438	627	COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			62 064
New Flyer Industries Inc.	18 976	753	1 029				
Stantec Inc.	20 433	659	667				
TFI International Inc.	30 232	797	846				
		4 834	5 666				
Consommation discrétionnaire (5,87 %)							
Dollarama Inc.	17 316	1 344	2 146				
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	9 109	309	363				
Magna International Inc.	18 932	1 079	1 137				
		2 732	3 646				
Consommation de base (5,73 %)							
Alimentation Couche-Tard Inc., Catégorie B	25 469	1 307	1 583				
Premium Brands Holdings Corp.	7 085	433	659				
Saputo Inc.	31 862	1 271	1 314				
		3 011	3 556				
Services financiers (27,22 %)							
Banque de Nouvelle-Écosse	35 527	2 800	2 771				
Banque Nationale du Canada	63 407	2 846	3 458				
Banque Royale du Canada	38 731	3 006	3 647				
Banque Toronto-Dominion	14 546	806	951				
ECN Capital Corp.	224 984	760	900				
Element Fleet Management Corp.	15 424	150	137				
Equitable Group Inc.	10 289	523	612				
Industrielle Alliance	36 898	1 769	2 076				
Intact Corporation financière	11 732	1 102	1 149				

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES MONTRUSCO BOLTON

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Objectif du Fonds

Le Fonds SSQ Actions canadiennes Montrusco Bolton (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 (toutes capitalisations). Le Fonds peut détenir des parts de fonds correspondant aux titres précités.

La stratégie d'investissement du gestionnaire externe, Placements Montrusco Bolton, est de gérer le portefeuille à environ 80 % selon une approche fondamentale toutes capitalisations et à environ 20 % selon une approche quantitative basée sur le « momentum » des titres. En ce qui a trait à l'approche fondamentale, la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante et un style de gestion majoritairement croissance. Il privilégie les entreprises dont l'évaluation des titres présente un fort potentiel de croissance.

Au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 et au 31 décembre 2016, l'exposition du Fonds au risque de crédit se limite à la détention de titres de marché monétaire. Par conséquent, le risque de crédit n'a pas d'impact significatif sur le Fonds.

Le Fonds peut participer à des opérations de prêts de titres. Au 30 juin 2017, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 15 112 \$ (19 030 \$ au 31 décembre 2016) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 16 164 \$ (20 353 \$ au 31 décembre 2016).

De plus, au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	256	-	256
Autres crédateurs	8	-	8

31 décembre 2016	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	33	-	33
Autres crédateurs	9	-	9

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, le Fonds est majoritairement investi en titre de participation. Par conséquent, une variation des taux d'intérêt n'aurait pas d'impact significatif sur le Fonds.

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 investit de 90 % à 100 % dans des actions canadiennes et jusqu'à un maximum de 10 % dans des titres de marché monétaire.

Pour les actions canadiennes, l'actif du Fonds doit être investi dans au moins sept secteurs de l'indice composé S&P/TSX. Le pourcentage des titres d'un même émetteur est limité à 8 % de l'actif du Fonds. Des exceptions sont permises pour les titres dont la pondération dans l'indice S&P/TSX est supérieure à 10 %. Dans ce cas, la limite permise est de 65 fois la pondération du titre dans l'indice composé S&P/TSX.

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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+ 5	3 097	2 947
- 5	(3 097)	(2 947)

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 2017 et au 31 décembre 2016, tous les titres du Fonds sont libellés en dollar canadien, la devise d'exploitation. Par conséquent, le Fonds n'est pas exposé au risque de change.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES MONTRUSCO BOLTON

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Actions canadiennes		
Énergie	13,81	15,06
Matériaux de base	10,70	9,35
Produits industriels	9,13	10,14
Consommation discrétionnaire	5,87	6,03
Consommation de base	5,73	5,22
Services financiers	27,22	29,03
Télécommunications	1,13	0,90
Technologies de l'information	5,19	3,23
Immobilier	1,82	-
Marché monétaire	0,44	1,58
Fonds de placement		
Actions canadiennes	19,19	18,90
Autres éléments d'actif net	(0,23)	0,56
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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	50 025	-	-	50 025
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	11 908	-	11 908
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	275	-	275
Total	50 025	12 183	-	62 208

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	47 551	-	-	47 551
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	11 381	-	11 381
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	949	-	949
Total	47 551	12 330	-	59 881

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	20 891	15 801
Trésorerie	4 805	20
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	2	2
Total de l'actif	25 698	15 823
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	4 830	-
Autres créditeurs	1	4
Total du passif	4 831	4
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 867	15 819
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,31	13,43
Classe B	13,07	13,26
Classe D	13,15	13,32
Classe E	13,43	13,51
Classe F	13,25	13,39
Classe G	13,08	13,27
Classe H	12,88	13,13
Classe I	14,05	13,95
Classe J	14,12	14,02
Classe N	13,42	13,51

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	114	25
Non réalisé(e) sur les placements	(436)	1 042
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	213	106
Total gain net (perte nette)	(109)	1 173
Distributions par le fonds sous-jacent	219	149
	110	1 322
Charges		
Frais de gestion (note 6)	273	238
Frais d'administration	7	6
Frais de transactions	-	-
	280	244
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(170)	1 078
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,13)	0,99
Classe B	(0,20)	0,92
Classe D	(0,18)	0,94
Classe E	(0,10)	1,03
Classe F	(0,15)	0,97
Classe G	(0,20)	0,93
Classe H	(0,26)	0,87
Classe I	0,10	1,20
Classe J	0,10	1,22
Classe N	(0,10)	1,02

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	15 819	10 121
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 636	4 753
Parts rachetées	(1 418)	(1 968)
	5 218	2 785
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(170)	1 078
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	20 867	13 984

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(170)	1 078
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	322	(1 067)
Distributions par le fonds sous-jacent	(432)	(255)
	(280)	(244)
Transactions de placements		
Acquisitions	(5 770)	(3 595)
Cessions	790	1 045
	(4 980)	(2 550)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	4 827	5
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(433)	(2 789)
Financement		
Parts émises	6 636	4 753
Parts rachetées	(1 418)	(1 968)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	5 218	2 785
Variation nette de la trésorerie	4 785	(4)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	20	42
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	4 805	38
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,12 %)			
Fonds BlackRock indiciel actions canadiennes, Classe D	626 345	18 773	20 891
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,12 %)			(24)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			20 867

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock indiciel actions canadiennes, Classe D</i>	%
Banque Royale du Canada	6,66
Banque Toronto-Dominion	5,86
Banque de Nouvelle-Écosse	4,55
Enbridge Inc.	4,11
Chemins de fer nationaux du Canada	3,87
Suncor Energy Inc.	3,07
Banque de Montréal	3,01
TransCanada Corp.	2,61
BCE Inc.	2,55
Société Financière Manuvie	2,34

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	20 891	-	-	20 891
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	20 891	-	-	20 891

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	15 801	-	-	15 801
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	15 801	-	-	15 801

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	36 512	39 082
Trésorerie	1 474	-
Cession de placements à recevoir	-	810
Autres débiteurs	-	2
Total de l'actif	37 986	39 894
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	713
Achat de placements à payer	1 405	-
Autres créditeurs	9	19
Total du passif	1 414	732
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	36 572	39 162
Valeur liquidative, par part		
Classe A	17,30	18,70
Classe B	16,90	18,40
Classe E	17,46	18,82
Classe F	17,21	18,63
Classe G	16,99	18,47
Classe I	18,34	19,48
Classe J	18,34	19,48
Classe N	17,45	18,81

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 512	387
Non réalisé(e) sur les placements	(3 802)	2 578
Total gain net (perte nette)	(2 290)	2 965
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(2 290)	2 965
Charges		
Frais de gestion (note 6)	404	376
Frais d'administration	11	10
Frais de transactions	-	-
	415	386
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 705)	2 579
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(1,42)	1,08
Classe B	(1,52)	0,96
Classe E	(1,38)	1,14
Classe F	(1,44)	1,06
Classe G	(1,50)	0,99
Classe I	(1,16)	1,40
Classe J	(1,16)	1,40
Classe N	(1,39)	1,13

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	39 162	35 818
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 315	5 354
Parts rachetées	(8 200)	(5 294)
	115	60
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 705)	2 579
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	36 572	38 457

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(2 705)	2 579
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 290	(2 965)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(415)	(386)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 335)	-
Cessions	3 615	1 060
	280	1 060
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2 207	(109)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	2 072	565
Financement		
Parts émises	8 315	5 354
Parts rachetées	(8 200)	(5 294)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	115	60
Variation nette de la trésorerie	2 187	625
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(713)	(666)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	1 474	(41)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,84 %)			
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	157 746	22 668	36 512
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,16 %)			60
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			36 572

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation
"Core"

	%
Tricon Capital Group Inc.	3,69
Intertape Polymer Group Inc.	3,30
New Flyer Industries Inc.	3,14
Badger Daylighting Ltd.	3,09
Sleep Country Canada	3,08
Parex Resources Inc.	3,06
Boyd Group Income Fund	2,99
Enghouse Systems Ltd.	2,97
Uni Select Inc.	2,72
Equitable Group Inc.	2,70

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (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". 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	36 512	-	-	36 512
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	36 512	-	-	36 512

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	39 082	-	-	39 082
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	39 082	-	-	39 082

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	59 478	57 899
Trésorerie	410	-
Cession de placements à recevoir	906	2 596
Autres débiteurs	22	24
Total de l'actif	60 816	60 519
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	2 184
Achat de placements à payer	790	-
Autres créditeurs	13	28
Total du passif	803	2 212
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	60 013	58 307
Valeur liquidative, par part		
Classe A	23,82	22,65
Classe B	23,39	22,37
Classe E	24,02	22,78
Classe F	23,71	22,58
Classe G	23,43	22,39
Classe I	25,27	23,60
Classe J	24,96	23,31
Classe K	28,62	26,73
Classe N	23,72	22,49

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	3 593	1 251
Non réalisé(e) sur les placements	(175)	(5 349)
Non-réalisé(e) sur les instruments financiers dérivés	-	(17)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	505	232
Total gain net (perte nette)	3 923	(3 883)
Prêts de titres	3	1
Dividendes	462	414
Écart de conversion sur la trésorerie	(20)	(123)
	4 368	(3 591)
Charges		
Retenues d'impôts	45	51
Frais de gestion (note 6)	64	36
Frais d'administration	2	1
Frais de transactions	27	34
	138	122
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 230	(3 713)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,24	(1,45)
Classe B	1,09	(1,55)
Classe E	1,31	(1,40)
Classe F	1,20	(1,48)
Classe G	1,10	(1,54)
Classe I	1,79	(1,10)
Classe J	1,73	(1,09)
Classe K	1,98	(1,25)
Classe N	1,29	(1,38)

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	58 307	67 273
Opérations sur les parts		
Parts émises	5 092	11 494
Parts rachetées	(7 616)	(14 360)
	(2 524)	(2 866)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 230	(3 713)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	60 013	60 694

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 230	(3 713)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	20	123
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(3 418)	4 098
Gain net (perte nette) non réalisé(e) sur les instruments financiers dérivés	-	17
Distributions par le fonds sous-jacent	(505)	(232)
	327	293
Transactions de placements		
Acquisitions	(29 675)	(28 791)
Cessions	32 019	31 979
	2 344	3 188
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2 467	(190)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	5 138	3 291
Financement		
Parts émises	5 092	11 494
Parts rachetées	(7 616)	(14 360)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(2 524)	(2 866)
Écart de conversion sur la trésorerie	(20)	(123)
Variation nette de la trésorerie	2 594	302
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(2 184)	663
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	410	965
Intérêts reçus	3	1
Dividendes reçus	416	327

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (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 (66,30 %)				ACTIONS (66,30 %) (suite)			
ACTIONS AMÉRICAINES (63,88 %)				ACTIONS AMÉRICAINES (63,88 %) (suite)			
Énergie (0,56 %)				Soins de santé (14,68 %) (suite)			
Alliance Resource Partners LP	13 700	400	336	HCA Healthcare Inc.	3 400	258	385
Matériaux de base (4,03 %)				Humana Inc.	1 300	371	406
Celanese Corp., Catégorie A	3 200	287	395	IDEXX Laboratories Inc.	2 300	330	482
Huntsman Corp.	12 500	424	419	Johnson & Johnson	2 400	325	412
Nucor Corp.	5 400	403	406	McKesson Corp.	1 600	205	342
Owens-Illinois Inc.	12 800	311	398	Quest Diagnostics Inc.	3 400	380	491
Silgan Holdings Inc.	9 600	382	396	Thermo Fisher Scientific Inc.	1 700	324	385
Steel Dynamics Inc.	8 700	420	404	UnitedHealth Group Inc.	1 900	224	457
		2 227	2 418	Vertex Pharmaceuticals Inc.	2 400	403	402
				WellCare Health Plans Inc.	1 700	400	396
					7 332		8 809
Produits industriels (9,15 %)				Services financiers (8,88 %)			
Allison Transmission Holdings Inc.	8 200	407	399	Aflac Inc.	4 000	405	403
Boeing Co.	1 600	407	411	Allstate Corp.	3 500	407	402
Delta Air Lines Inc.	5 000	325	349	Ameriprise Financial Inc.	2 500	393	413
Landstar System Inc.	4 000	388	445	Apollo Global Management LLC, Catégorie A	12 100	364	416
ManpowerGroup Inc.	3 000	334	435	Citizens Financial Group Inc.	8 400	427	389
Masco Corp.	8 500	327	422	Hill-Rom Holdings Inc.	4 100	407	424
Owens Corning	5 400	407	469	Leucadia National Corp.	11 800	408	401
Pitney Bowes Inc.	19 900	398	390	MSCI Inc.	2 900	405	388
Robert Half International Inc.	6 500	422	404	Prudential Financial Inc.	2 700	372	379
Southwest Airlines Co.	4 900	91	395	S&P Global Inc.	2 200	415	417
Spirit AeroSystems Holdings Inc., Catégorie A	3 000	189	225	SEI Investments Co.	5 600	402	391
The Toro Co.	4 700	375	423	The Hartford Financial Services Group Inc.	6 300	426	430
United Continental Holdings Inc.	3 200	272	313	The progressive Corp.	8 300	407	475
United Rentals Inc.	2 800	281	410		5 238		5 328
		4 623	5 490				
Consommation discrétionnaire (5,97 %)				Technologies de l'information (18,96 %)			
Brunswick Corp.	4 700	261	383	Adobe Systems Inc.	2 100	400	386
CBS Corp., Catégorie B	4 800	398	398	Analog Devices Inc.	3 600	392	364
Dr Horton Inc.	8 900	394	399	Apple Inc.	2 700	233	505
Home Depot Inc.	2 000	213	398	Applied Materials Inc.	9 300	237	499
Lear Corp.	1 800	248	332	Broadcom Ltd.	1 200	413	363
Lowe's Cos Inc.	4 100	392	413	Cadence Design Systems Inc.	9 000	410	391
NVR Inc.	150	324	469	CDK Global Inc.	4 400	326	355
Pool Corp.	2 600	424	397	CDW Corp.	5 600	388	455
Staples Inc.	30 300	433	396	Cisco Systems Inc.	9 600	392	390
		3 087	3 585	Citrix Systems Inc.	3 700	415	382
				Cognizant Technology Solutions Corp., Catégorie A	3 900	166	336
Consommation de base (1,65 %)				Corning Inc.	9 700	309	378
Pilgrim's Pride Corp.	12 800	339	364	eBay Inc.	9 000	277	408
The Hershey Co.	2 100	301	293	F5 Networks Inc.	2 300	361	379
Tyson Foods Inc., Catégorie A	4 100	351	333	HP Inc.	20 100	391	456
		991	990	Intuit Inc.	2 200	405	379
				Juniper Networks Inc.	10 500	404	380
Soins de santé (14,68 %)				Lam Research Corp.	2 600	331	477
AbbVie Inc.	4 700	428	443	Microsoft Corp.	4 200	341	376
Aetna Inc.	2 200	423	434	Motorola Solutions Inc.	3 600	360	405
Amgen Inc.	1 900	425	425	NCR Corp.	7 500	317	398
Anthem Inc.	1 700	414	415	NetApp Inc.	8 800	393	458
Baxter International Inc.	6 500	401	511	ON Semiconductor Corp.	20 700	423	377
Biogen Inc.	1 000	288	352	Teradyne Inc.	8 700	414	339
Bristol-Myers Squibb Co.	5 700	418	412	Texas Instruments Inc.	3 600	335	360
Celgene Corp.	900	54	152	Total System Services Inc.	5 500	356	416
Cigna Corp.	2 100	406	456	Western Digital Corp.	4 800	389	552
Edwards Lifesciences Corp.	2 300	108	353				
Express Scripts Holding Co.	4 100	386	340				
Gilead Sciences Inc.	3 900	361	358				

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, sauf le nombre d'actions et de parts)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
ACTIONS (66,30 %) (suite)			
ACTIONS AMÉRICAINES (63,88 %) (suite)			
Technologies de l'information (18,96 %) (suite)			
Zynga Inc.	86 900	409	411
		9 987	11 375
TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES		33 885	38 331
ACTIONS INTERNATIONALES (2,42 %)			
Consommation discrétionnaire (0,43 %)			
Michael Kors Holdings Ltd.	5 500	382	259
Soins de santé (0,59 %)			
ICON PLC	2 800	201	356
Services financiers (1,40 %)			
Everest RE Group Ltd.	1 200	401	397
Lazard Ltd., Catégorie A	7 400	365	445
		766	842
TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		1 349	1 457
TOTAL ACTIONS		35 234	39 788
	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
FONDS DE PLACEMENT (32,81 %)			
Hillsdale US Performance Equity, Class Z	116 768	16 416	19 690
TOTAL DES PLACEMENTS (99,11 %)		51 650	59 478
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,89 %)			535
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			60 013

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 5 194 \$ (10 812 \$ au 31 décembre 2016) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 5 558 \$ (11 569 \$ au 31 décembre 2016).

De plus, au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016 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 2017	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	790	-	790
Autres créditeurs	13	-	13

31 décembre 2016	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres créditeurs	28	-	28

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+ 5	2 974	2 895
- 5	(2 974)	(2 895)

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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
Dollar canadien	+ 5	(2 974)	(2 895)
	- 5	2 974	2 895

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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 audités)
Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Actions américaines		
Énergie	0,56	1,37
Matériaux de base	4,03	3,80
Produits industriels	9,15	9,31
Consommation discrétionnaire	5,97	9,85
Consommation de base	1,65	1,77
Soins de santé	14,68	11,47
Services financiers	8,88	6,80
Télécommunications	-	0,66
Technologies de l'information	18,96	20,71
Actions internationales		
Produits industriels	-	0,73
Consommation discrétionnaire	0,43	-
Soins de santé	0,59	-
Services financiers	1,40	-
Fonds de placement		
Actions américaines	32,81	32,83
Autres éléments d'actif net		
	0,89	0,70
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 2017				
Actifs financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	39 788	-	-	39 788
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	19 690	-	-	19 690
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	59 478	-	-	59 478

31 décembre 2016				
Actifs financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	38 756	-	-	38 756
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	19 143	-	-	19 143
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	57 899	-	-	57 899

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	30 juin	31 décembre
Aux	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	41 678	24 157
Trésorerie	550	304
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	20	1
Total de l'actif	42 248	24 462
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	460	260
Autres créditeurs	-	8
Total du passif	460	268
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 788	24 194
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,21	11,51
Classe B	11,99	11,36
Classe E	12,31	11,58
Classe F	12,15	11,47
Classe G	12,00	11,37
Classe I	12,93	11,98
Classe J	12,93	11,98
Classe N	12,31	11,58

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	24	(3)
Non réalisé(e) sur les placements	2 152	685
Total gain net (perte nette)	2 176	682
Distributions par le fonds sous-jacent	3	-
	2 179	682
Charges		
Frais de gestion (note 6)	597	80
Frais d'administration	18	2
Frais de transactions	-	-
	615	82
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 564	600
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,54	1,56
Classe B	0,47	1,48
Classe E	0,58	1,52
Classe F	0,53	1,37
Classe G	0,47	1,39
Classe I	0,80	1,50
Classe J	0,79	1,53
Classe N	0,58	1,63

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	24 194	620
Opérations sur les parts		
Parts émises	22 690	21 126
Parts rachetées	(6 660)	(1 124)
	16 030	20 002
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 564	600
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	41 788	21 222

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 564	600
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 176)	(682)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(612)	(82)
Transactions de placements		
Acquisitions	(15 590)	(20 435)
Cessions	245	560
	(15 345)	(19 875)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	173	(99)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(15 784)	(20 056)
Financement		
Parts émises	22 690	21 126
Parts rachetées	(6 660)	(1 124)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	16 030	20 002
Variation nette de la trésorerie	246	(54)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	304	85
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	550	31
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,74 %)			
Beutel Goodman American Equity Fund, Class I	2 430 336	37 174	41 678
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,26 %)			110
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>41 788</u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Beutel Goodman American Equity Fund, Class I</i>	%
Oracle Corp.	6,60
Ingersoll-Rand PLC	6,50
American Express Co.	6,30
Parker Hannifin Corp.	6,00
Verizon Communications Inc.	5,90
Amdocs Ltd.	5,40
AmerisourceBergen Corp.	5,40
Eli Lilly & Co.	5,00
Omnicom Group Inc.	4,80
Ameriprise Financial Inc.	4,50

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 Beutel Goodman American Equity, Class 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	41 678	-	-	41 678
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	41 678	-	-	41 678

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	24 157	-	-	24 157
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	24 157	-	-	24 157

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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		
Aux	30 juin 2017	31 décembre 2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	41 464	45 516
Trésorerie	52	-
Cession de placements à recevoir	-	365
Autres débiteurs	-	4
Total de l'actif	41 516	45 885
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	342
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	3	3
Total du passif	3	345
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 513	45 540
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,39	10,57
Classe B	11,19	10,44
Classe D	11,23	10,47
Classe E	11,49	10,63
Classe F	11,34	10,54
Classe G	11,20	10,45
Classe H	11,02	10,33
Classe I	12,05	10,99
Classe J	12,05	10,99
Classe N	11,48	10,63

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	973	(6)
Non réalisé(e) sur les placements	3 040	366
Total gain net (perte nette)	4 013	360
Distributions par le fonds sous-jacent	-	24
	4 013	384
Charges		
Frais de gestion (note 6)	775	145
Frais d'administration	21	4
Frais de transactions	-	-
	796	149
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 217	235
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,84	0,38
Classe B	0,77	0,31
Classe D	0,79	0,34
Classe E	0,88	0,39
Classe F	0,83	0,34
Classe G	0,77	0,28
Classe H	0,71	0,24
Classe I	1,09	0,61
Classe J	1,03	0,63
Classe N	0,88	0,43

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	45 540	1 117
Opérations sur les parts		
Parts émises	5 046	47 402
Parts rachetées	(12 290)	(1 431)
	(7 244)	45 971
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 217	235
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	41 513	47 323

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 217	235
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(4 013)	(360)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	(24)
	(796)	(149)
Transactions de placements		
Acquisitions	-	(46 955)
Cessions	8 065	1 185
	8 065	(45 770)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	369	(185)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	7 638	(46 104)
Financement		
Parts émises	5 046	47 402
Parts rachetées	(12 290)	(1 431)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(7 244)	45 971
Variation nette de la trésorerie	394	(133)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(342)	87
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	52	(46)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,88 %)			
Fonds Fiera Actions américaines, Classe A	3 849 049	<u>34 871</u>	<u>41 464</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,12 %)			<u>49</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>41 513</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Actions américaines, Classe A</i>	%
Moody's Corp.	6,36
Johnson & Johnson	5,94
Becton Dickinson and Co.	4,79
MasterCard Inc., Catégorie A	4,71
PepsiCo Inc.	4,14
3M Company	4,14
US Bancorp	4,13
UnitedHealth Group Inc.	4,06
United Technologies Corp.	3,98
The Sherwin Williams Co	3,95

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (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, Classe 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	41 464	-	-	41 464
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	41 464	-	-	41 464

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	45 516	-	-	45 516
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	45 516	-	-	45 516

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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		
Aux	30 juin 2017	31 décembre 2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	3 597	709
Trésorerie	196	-
Cession de placements à recevoir	-	185
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	3 793	894
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	182
Achat de placements à payer	135	-
Autres créditeurs	1	-
Total du passif	136	182
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	3 657	712
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,08	10,02
Classe B	11,00	10,01
Classe E	11,11	10,02
Classe F	11,06	10,02
Classe G	11,01	10,01
Classe I	11,32	10,06
Classe J	11,32	10,06
Classe N	11,11	10,02

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)

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL		2017
Période terminée le 30 juin		\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2	
Non réalisé(e) sur les placements	186	
Total gain net (perte nette)	188	
Distributions par le fonds sous-jacent	-	
	188	
Charges		
Frais de gestion (note 6)	25	
Frais d'administration	1	
Frais de transactions	-	
	26	
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs		162
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A		0,89
Classe B		0,81
Classe E		0,91
Classe F		0,87
Classe G		0,81
Classe I		1,08
Classe J		1,07
Classe N		0,91

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

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

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

Période terminée le 30 juin	2017
	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	712
Opérations sur les parts	
Parts émises	3 544
Parts rachetées	(761)
	2 783
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	162
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	3 657

ÉTAT DES FLUX DE TRÉSORERIE

Période terminée le 30 juin	2017
	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:	
Opérationnelles	
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	162
Éléments sans incidence sur la trésorerie	
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(188)
Distributions par le fonds sous-jacent	-
	(26)
Transactions de placements	
Acquisitions	(3 000)
Cessions	300
	(2 700)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	321
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(2 405)
Financement	
Parts émises	3 544
Parts rachetées	(761)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	2 783
Variation nette de la trésorerie	378
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(182)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	196
Intérêts reçus	-
Dividendes reçus	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (98,36 %)			
Fonds Fiera Actions américaines, Classe C	337 739	3 419	3 597
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (1,64 %)			60
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			3 657

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Actions américaines, Classe C</i>	%
Moody's Corp.	6,36
Johnson & Johnson	5,94
Becton Dickinson and Co.	4,79
MasterCard Inc., Catégorie A	4,71
PepsiCo Inc.	4,14
3M Company	4,14
US Bancorp	4,13
UnitedHealth Group Inc.	4,06
United Technologies Corp.	3,98
The Sherwin - Williams Co.	3,95

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 2017 (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, Classe 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	3 597	-	-	3 597
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	3 597	-	-	3 597

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	709	-	-	709
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	709	-	-	709

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	42 307	42 033
Trésorerie	16	5
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	3	3
Total de l'actif	42 326	42 041
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	7	6
Total du passif	7	6
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	42 319	42 035
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,37	12,86
Classe B	13,12	12,69
Classe D	13,19	12,73
Classe E	13,48	12,93
Classe F	13,32	12,82
Classe G	13,15	12,71
Classe H	12,93	12,56
Classe I	14,13	13,36
Classe J	14,29	13,52
Classe N	13,48	12,93

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 244	1 053
Non réalisé(e) sur les placements	148	(3 558)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	497	846
Total gain net (perte nette)	1 889	(1 659)
Distributions par le fonds sous-jacent	495	463
	2 384	(1 196)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	670	568
Frais d'administration	19	16
Frais de transactions	-	-
	689	584
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 695	(1 780)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,52	(0,58)
Classe B	0,43	(0,64)
Classe D	0,46	(0,62)
Classe E	0,56	(0,55)
Classe F	0,50	(0,60)
Classe G	0,44	(0,64)
Classe H	0,37	(0,69)
Classe I	0,78	(0,39)
Classe J	0,78	(0,39)
Classe N	0,55	(0,55)

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	42 035	38 160
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 676	12 827
Parts rachetées	(8 087)	(10 108)
	(1 411)	2 719
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 695	(1 780)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	42 319	39 099

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 695	(1 780)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 392)	2 505
Distributions par le fonds sous-jacent	(992)	(1 309)
	(689)	(584)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 280)	(6 635)
Cessions	4 390	4 480
	2 110	(2 155)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1	58
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 422	(2 681)
Financement		
Parts émises	6 676	12 827
Parts rachetées	(8 087)	(10 108)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 411)	2 719
Variation nette de la trésorerie	11	38
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	5	42
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	16	80
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,97 %)			
Fonds BlackRock CAD indiciel actions ÉU, Classe D	2 045 067	<u>30 104</u>	<u>42 307</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,03 %)			<u>12</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>42 319</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock CAD indiciel actions ÉU, Classe D</i>	%
Apple Inc.	3,62
Microsoft Corp.	2,56
Amazon.com Inc.	1,85
Facebook Inc., Catégorie A	1,72
Johnson & Johnson	1,72
Exxon Mobil Corp.	1,65
JPMorgan Chase & Co.	1,56
Berkshire Hathaway Inc., Catégorie B	1,55
Alphabet Inc., Catégorie A	1,33
Alphabet Inc., Catégorie C	1,31

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	42 307	-	-	42 307
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	42 307	-	-	42 307

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	42 033	-	-	42 033
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	42 033	-	-	42 033

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES HEXAVEST

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	104 991	116 861
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	2 400	690
Autres débiteurs	-	2
Total de l'actif	107 391	117 553
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	1 735	324
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	32	34
Total du passif	1 767	358
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	105 624	117 195
Valeur liquidative, par part		
Classe A	9,95	9,42
Classe B	9,75	9,29
Classe D	9,80	9,32
Classe E	10,04	9,48
Classe F	9,91	9,39
Classe G	9,77	9,30
Classe H	9,62	9,20
Classe I	10,64	9,87
Classe J	10,64	9,87
Classe N	10,04	9,48

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES HEXAVEST

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(3 380)	(531)
Non réalisé(e) sur les placements	11 965	(7 086)
Total gain net (perte nette)	8 585	(7 617)
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
	8 585	(7 616)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	189	192
Frais d'administration	4	4
Frais de transactions	-	-
	193	196
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	8 392	(7 812)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,55	(0,73)
Classe B	0,48	(0,79)
Classe D	0,49	(0,77)
Classe E	0,58	(0,71)
Classe F	0,53	(0,75)
Classe G	0,48	(0,78)
Classe H	0,43	(0,82)
Classe I	0,79	(0,56)
Classe J	0,79	(0,56)
Classe N	0,58	(0,71)

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES HEXAVEST

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	117 195	133 477
Opérations sur les parts		
Parts émises	5 311	7 132
Parts rachetées	(25 274)	(6 304)
	(19 963)	828
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	8 392	(7 812)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	105 624	126 493

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	8 392	(7 812)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(8 585)	7 616
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(193)	(196)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 110)	(2 860)
Cessions	21 565	2 375
	20 455	(485)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1 710)	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	18 552	(683)
Financement		
Parts émises	5 311	7 132
Parts rachetées	(25 274)	(6 304)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(19 963)	828
Variation nette de la trésorerie	(1 411)	145
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(324)	502
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(1 735)	647
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES HEXAVEST

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,40 %)			
Fonds Hexavest Europac	130 483	118 336	104 991
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,60 %)			633
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			105 624

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Hexavest Europac</i>	%
Nestlé SA	2,72
Roche Holding AG	1,98
Novartis AG	1,92
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	1,76
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	1,47
BNP Paribas SA	1,42
Mizuho Financial Group Inc.	1,42
ING Groep NV	1,33
Banco Santander SA	1,28
Intesa Sanpaolo SpA	1,26

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES HEXAVEST

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions internationales Hexavest est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Hexavest Europac. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions internationales Hexavest 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 Hexavest Gestion d'actifs 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 valeur. Le gestionnaire met l'accent sur les facteurs macroéconomiques tout en utilisant une stratégie basée sur la recherche fondamentale et supportée par des modèles quantitatifs.

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	104 991	-	-	104 991
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	104 991	-	-	104 991

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	116 861	-	-	116 861
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	116 861	-	-	116 861

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	101 759	96 786
Trésorerie	1 729	1 615
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	226	64
Total de l'actif	103 714	98 465
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	29	41
Total du passif	29	41
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	103 685	98 424
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,18	12,58
Classe B	13,89	12,40
Classe E	14,30	12,66
Classe F	14,11	12,54
Classe G	13,92	12,42
Classe I	15,11	13,16
Classe J	15,11	13,16
Classe K	15,11	13,16
Classe N	14,29	12,65

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2 920	2 310
Non réalisé(e) sur les placements	10 202	(12 112)
Total gain net (perte nette)	13 122	(9 802)
Intérêts aux fins d'attribution	3	1
Prêts de titres	1	-
Dividendes	1 590	2 066
Écart de conversion sur la trésorerie	-	(6)
	14 716	(7 741)
Charges		
Retenues d'impôts	98	190
Frais de gestion (note 6)	282	320
Frais d'administration	7	8
Frais de transactions	45	79
	432	597
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 284	(8 338)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,64	(1,22)
Classe B	1,53	(1,30)
Classe E	1,69	(1,20)
Classe F	1,61	(1,24)
Classe G	1,55	(1,29)
Classe I	2,03	(1,00)
Classe J	2,02	(1,00)
Classe K	2,01	(1,00)
Classe N	1,68	(1,20)

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	98 424	105 788
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 815	17 757
Parts rachetées	(17 838)	(17 970)
	(9 023)	(213)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 284	(8 338)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	103 685	97 237

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 284	(8 338)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	-	6
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(13 122)	9 802
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	1 162	1 470
Transactions de placements		
Acquisitions	(12 477)	(20 115)
Cessions	20 626	20 266
	8 149	151
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(174)	(1 934)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	9 137	(313)
Financement		
Parts émises	8 815	17 757
Parts rachetées	(17 838)	(17 970)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(9 023)	(213)
Écart de conversion sur la trésorerie	-	(6)
Variation nette de la trésorerie	114	(532)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	1 615	1 724
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	1 729	1 192
Intérêts reçus	4	1
Dividendes reçus	1 330	1 681

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur		Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
ACTIONS AMÉRICAINES (2,33 %)				ACTIONS INTERNATIONALES (95,81 %) (suite)			
Soins de santé (2,33 %)				Technologies de l'information (15,81 %)			
Shire PLC	33 834	2 644	2 419	Hexagon AB, Catégorie B	25 428	1 358	1 566
TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES		<u>2 644</u>	<u>2 419</u>	Infineon Technologies AG	114 515	2 101	3 162
ACTIONS INTERNATIONALES (95,81 %)				Keyence Corp.	7 100	2 089	4 049
Énergie (4,29 %)				SAP SE	23 367	2 775	3 180
Royal Dutch Shell PLC, Catégorie A	129 216	4 455	4 449	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	97 649	2 953	4 432
Matériaux de base (1,92 %)						<u>11 276</u>	<u>16 389</u>
CRH PLC	43 111	1 980	1 988	Immobilier (3,44 %)			
Produits industriels (16,42 %)				Sun Hung Kai Properties Ltd.	187 000	2 875	3 567
Atlas Copco AB	43 862	1 910	2 179	TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		<u>72 082</u>	<u>99 340</u>
FANUC Corp.	10 900	1 847	2 728	TOTAL DES PLACEMENTS (98,14 %)		<u>74 726</u>	<u>101 759</u>
Jardine Matheson Holdings Ltd.	27 700	1 875	2 309	AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (1,86 %)			<u>1 926</u>
Makita Corp.	67 600	1 582	3 246	TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>103 685</u>
Siemens AG	17 070	2 808	3 054				
Wolseley PLC	44 118	2 248	3 507				
		<u>12 270</u>	<u>17 023</u>				
Consommation discrétionnaire (11,17 %)							
Bridgestone Corp.	70 400	2 206	3 938				
Naspers Ltd.	18 811	3 378	4 745				
Shimano Inc.	14 100	2 557	2 897				
		<u>8 141</u>	<u>11 580</u>				
Consommation de base (11,86 %)							
British American Tobacco PLC	74 636	4 369	6 589				
Nestlé SA	27 043	1 731	3 057				
Reckitt Benckiser Group PLC	20 228	2 536	2 656				
		<u>8 636</u>	<u>12 302</u>				
Soins de santé (8,92 %)							
Bayer AG	26 234	4 321	4 404				
Novo Nordisk A/S, Catégorie B	59 622	2 024	3 313				
Sinopharm Group Co. Ltd.	261 200	1 811	1 533				
		<u>8 156</u>	<u>9 250</u>				
Services financiers (20,55 %)							
AIA Group Ltd.	519 400	4 315	4 927				
Danske Bank A/S	67 207	1 560	3 353				
HDFC Bank Ltd.	74 004	2 935	8 357				
NN Group NV	30 707	1 412	1 416				
UBS Group AG	148 059	2 670	3 257				
		<u>12 892</u>	<u>21 310</u>				
Télécommunications (1,43 %)							
SoftBank Group Corp.	14 100	1 401	1 482				

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 les styles de gestion croissance et valeur à parts égales. 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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 76 \$ (5 112 \$ au 31 décembre 2016) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 81 \$ (5 470 \$ au 31 décembre 2016).

De plus, au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	29	-	29

31 décembre 2016	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	41	-	41

Risque de taux d'intérêt

Au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+ 5	5 088	4 839
- 5	(5 088)	(4 839)

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 2017 (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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
Couronne danoise	6 666	6 071
Couronne suédoise	3 745	1 390
Dollar américain	15 097	13 731
Dollar de Hong Kong	10 028	9 213
Euro	19 666	18 019
Franc suisse	6 314	11 988
Livre sterling	17 159	14 714
Rand sud-africain	4 744	3 927
Yen japonais	18 340	17 733
Total	101 759	96 786

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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
Dollar canadien	+ 5	(5 088)	(4 839)
	- 5	5 088	4 839

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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Actions américaines		
Soins de santé	2,33	-
Actions internationales		
Énergie	4,29	5,04
Matériaux de base	1,92	5,32
Produits industriels	16,42	15,00
Consommation discrétionnaire	11,17	13,05
Consommation de base	11,86	11,86
Soins de santé	8,92	10,75
Services financiers	20,55	17,32
Télécommunications	1,43	-
Technologies de l'information	15,81	16,53
Immobilier	3,44	3,47
Autres éléments d'actif net	1,86	1,66
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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	101 759	-	-	101 759
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	101 759	-	-	101 759

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	96 786	-	-	96 786
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	96 786	-	-	96 786

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	49 148	40 578
Trésorerie	5 837	-
Cession de placements à recevoir	-	920
Autres débiteurs	2	1
Total de l'actif	54 987	41 499
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	828
Achat de placements à payer	5 560	-
Autres créditeurs	9	8
Total du passif	5 569	836
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	49 418	40 663
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,02	12,02
Classe B	12,76	11,85
Classe D	12,83	11,89
Classe E	13,13	12,09
Classe F	12,96	11,97
Classe G	12,78	11,86
Classe H	12,59	11,74
Classe I	13,83	12,53
Classe J	13,83	12,53
Classe N	13,13	12,09

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	623	472
Non réalisé(e) sur les placements	2 918	(6 668)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	190	1 254
Total gain net (perte nette)	3 731	(4 942)
Distributions par le fonds sous-jacent	484	422
	4 215	(4 520)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	116	115
Frais d'administration	2	2
Frais de transactions	-	-
	118	117
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 097	(4 637)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,01	(1,44)
Classe B	0,92	(1,50)
Classe D	0,94	(1,48)
Classe E	1,06	(1,42)
Classe F	0,99	(1,45)
Classe G	0,92	(1,49)
Classe H	0,86	(1,54)
Classe I	1,31	(1,24)
Classe J	1,31	(1,24)
Classe N	1,05	(1,41)

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	40 663	42 483
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 160	8 580
Parts rachetées	(3 502)	(8 249)
	4 658	331
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 097	(4 637)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	49 418	38 177

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 097	(4 637)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(3 541)	6 196
Distributions par le fonds sous-jacent	(674)	(1 676)
	(118)	(117)
Transactions de placements		
Acquisitions	(7 770)	(6 205)
Cessions	3 415	5 385
	(4 355)	(820)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	6 480	(3 979)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	2 007	(4 916)
Financement		
Parts émises	8 160	8 580
Parts rachetées	(3 502)	(8 249)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	4 658	331
Variation nette de la trésorerie	6 665	(4 585)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(828)	(668)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	5 837	(5 253)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,45 %)			
Fonds BlackRock CAD indiciel actions MSCI EAEO, Classe D	2 773 326	<u>40 902</u>	<u>49 148</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,55 %)			<u>270</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>49 418</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds BlackRock CAD indiciel actions MSCI EAEO, Classe D</i>	%
Nestlé SA	1,98
Novartis AG	1,36
HSBC Holdings PLC	1,35
Roche Holding AG	1,31
Toyota Motor Corp.	1,01
British American Tobacco PLC	0,93
Royal Dutch Shell PLC, Catégorie A	0,86
Total SA	0,84
BP PLC	0,83
Sanofi	0,82

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	49 148	-	-	49 148
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	49 148	-	-	49 148

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	40 578	-	-	40 578
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	40 578	-	-	40 578

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	30 864	35 394
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	1 347	1 188
Autres débiteurs	72	63
Total de l'actif	32 283	36 645
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	1 922	608
Achat de placements à payer	128	260
Autres créditeurs	16	32
Total du passif	2 066	900
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	30 217	35 745
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,89	13,32
Classe B	13,61	13,14
Classe D	13,52	13,08
Classe E	14,00	13,40
Classe F	13,86	13,30
Classe G	13,65	13,16
Classe H	13,44	13,02
Classe I	14,85	13,96
Classe J	14,85	13,96
Classe N	14,01	13,40

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 943	581
Non réalisé(e) sur les placements	10	(2 982)
Total gain net (perte nette)	1 953	(2 401)
Intérêts aux fins d'attribution	74	63
Dividendes	313	234
Écart de conversion sur la trésorerie	(11)	(10)
	2 329	(2 114)
Charges		
Retenues d'impôts	33	22
Frais de gestion (note 6)	182	167
Frais d'administration	4	4
Frais de transactions	14	12
	233	205
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 096	(2 319)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,59	(1,09)
Classe B	0,50	(1,16)
Classe D	0,47	(1,18)
Classe E	0,64	(1,06)
Classe F	0,59	(1,10)
Classe G	0,51	(1,15)
Classe H	0,45	(1,21)
Classe I	0,93	(0,84)
Classe J	0,93	(0,84)
Classe N	0,64	(1,06)

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	35 745	31 998
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 744	9 245
Parts rachetées	(11 368)	(1 942)
	(7 624)	7 303
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 096	(2 319)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	30 217	36 982

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 096	(2 319)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	11	10
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 949)	2 401
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	158	92
Transactions de placements		
Acquisitions	(11 067)	(15 878)
Cessions	17 546	10 516
	6 479	(5 362)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(316)	197
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	6 321	(5 073)
Financement		
Parts émises	3 744	9 245
Parts rachetées	(11 368)	(1 942)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(7 624)	7 303
Écart de conversion sur la trésorerie	(11)	(10)
Variation nette de la trésorerie	(1 314)	2 220
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(608)	285
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(1 922)	2 505
Intérêts reçus	61	60
Dividendes reçus	280	196

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Valeur nominale	Coût moyen	Juste valeur		Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$			\$	\$
OBLIGATIONS (37,23 %)				ACTIONS (64,91 %) (suite)			
OBLIGATIONS ÉTRANGÈRES (37,23 %)				ACTIONS ORDINAIRES (56,94 %) (suite)			
Sociétés (37,23 %)				ACTIONS AMÉRICAINES (27,48 %) (suite)			
AURELIUS SE & Co., 1,00 %, 01-12-2020 C	100	157	161	Énergie (1,48 %) (suite)			
Bayer Capital Corp., 5,63 %, 22-11-2019 C	200	297	362	Schlumberger Ltd.	2 395	202	205
Cemex SAB de CV, 3,72 %, 15-03-2020 C	110	168	165			482	448
Compagnie Générale des Etablissements Michelin, 0,00 %, 10-01-2022 C	200	281	271				
Ctrip.com International Ltd., 1,00 %, 01-07-2020 C	442	649	662	Matériaux de base (0,80 %)			
Cypress Semiconductor Corp., 4,55 %, 15-01-2022 C	165	280	264	Newmont Mining Corp.	5 750	227	242
DISH Network Corp., 3,38 %, 15-08-2026 C	238	342	374				
ENI SpA, 0,00 %, 13-04-2022 C	100	152	151	Produits industriels (0,59 %)			
Finisar Corp., 0,50 %, 15-12-2036 C	135	184	174	United Technologies Corp.	1 125	164	178
Haitong International Securities Group Ltd., 0,00 %, 25-10-2021 C	2 000	360	337				
Illumina Inc., 0,00 %, 15-06-2019 C	295	405	391	Consommation discrétionnaire (1,91 %)			
Kandenko Ltd., 0,00 %, 31-03-2021 C	30 000	392	402	Dr Horton Inc.	7 400	308	332
Kansai Paint Co Ltd., 0,00 %, 17-06-2019 C	10 000	128	127	NIKE Inc., Catégorie B	3 200	214	245
Larsen & Toubro Ltd., 0,68 %, 22-10-2019 C	282	361	372			522	577
Liberty Interactive LLC, 1,75 %, 30-09-2046 C	365	508	540	Consommation de base (1,55 %)			
Lumentum Holdings Inc., 0,25 %, 15-03-2024 C	140	190	213	Coca-Cola Co.	3 165	144	184
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE, 0,00 %, 16-02-2021 C	303	440	446	Wal-Mart Stores Inc.	2 900	275	285
Magyar Nemzeti Vagyonkezelő Zrt, 3,38 %, 02-04-2019 C	100	167	186			419	469
Meditata Solutions Inc., 1,00 %, 01-08-2018 C	90	122	164	Soins de santé (5,28 %)			
Nice Systems Inc., 1,25 %, 15-01-2024 C	135	183	196	Baxter International Inc.	4 110	262	323
ON Semiconductor Corp., 1,00 %, 01-12-2020 C	260	382	351	Celgene Corp.	1 850	276	312
PDC Energy Inc., 1,13 %, 15-09-2021 C	245	374	290	Johnson & Johnson	2 165	182	372
Priceline Group Inc., 0,90 %, 15-09-2021 C	570	755	851	Merck & Co. Inc.	2 850	215	237
Prysman SPA, 1,25 %, 08-03-2018 C	200	330	353	Shire PLC	2 200	183	157
RealPage Inc., 1,55 %, 15-11-2022	135	185	191	UnitedHealth Group Inc.	800	169	193
Safran SA, 0,00 %, 31-12-2020 C	282	464	459			1 287	1 594
Sagerpar SA, 0,38 %, 09-10-2018 C	200	325	323	Services financiers (5,43 %)			
Silicon Laboratories Inc., 1,38 %, 01-03-2022 C	135	184	181	Bank of America Corp.	12 790	329	403
Square Inc., 0,38 %, 01-03-2022 C	205	280	326	Citigroup Inc.	3 055	195	265
Telenor East Holding II AS, 0,25 %, 20-09-2019 C	400	577	573	JPMorgan Chase & Co.	3 620	311	430
Tesla Motors Inc., 1,25 %, 01-03-2021 C	237	301	358	PNC Financial Services Group Inc.	1 500	211	243
Tullow Oil Ltd., 6,63 %, 12-07-2021 C	200	354	273	Wells Fargo & Co.	4 175	211	300
Valeo SA, 0,00 %, 16-06-2021 C	200	308	286			1 257	1 641
Weatherford International Ltd., 5,88 %, 01-07-2021 C	210	346	275	Télécommunications (0,45 %)			
Workday Inc., 0,75 %, 15-07-2018 C	125	186	202	AT&T Inc.	2 800	156	137
TOTAL OBLIGATIONS ÉTRANGÈRES		11 117	11 250	Technologies de l'information (9,99 %)			
TOTAL OBLIGATIONS		11 117	11 250	Alphabet Inc., Catégorie A	810	571	978
				Apple Inc.	3 100	321	580
				Broadcom Ltd.	970	216	293
				Facebook Inc., Catégorie A	1 660	195	325
				Lam Research Corp.	733	75	135
				MasterCard Inc., Catégorie A	1 380	153	218
				Microsoft Corp.	5 450	343	488
						1 874	3 017
				TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES		6 388	8 303
ACTIONS (64,91 %)				ACTIONS INTERNATIONALES (29,46 %)			
ACTIONS ORDINAIRES (56,94 %)				Énergie (1,88 %)			
ACTIONS AMÉRICAINES (27,48 %)				Royal Dutch Shell PLC, Catégorie A	8 945	297	308
Énergie (1,48 %)				Total SA	4 050	277	260
Anadarko Petroleum Corp.	1 800	142	106			574	568
Exxon Mobil Corp.	1 310	138	137				

C: titre convertible.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$		Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$
ACTIONS (64,91 %) (suite)				ACTIONS (64,91 %) (suite)			
ACTIONS ORDINAIRES (56,94 %) (suite)				ACTIONS PRIVILÉGIÉES (7,97 %)			
ACTIONS INTERNATIONALES (29,46 %) (suite)				ACTIONS AMÉRICAINES PRIVILÉGIÉES (7,97 %)			
Matériaux de base (1,37 %)				Allergan PLC, 5,50 %, 01-03-2018 C	690	789	778
CRH PLC	3 650	161	168	American Tower Corp., Catégorie B, 5,25 % C	673	105	106
Glencore PLC	50 781	282	246	Anthem Inc., 5,25 %, 01-05-2018 C	3 200	197	219
		<u>443</u>	<u>414</u>	Mandatory Exchangeable Trust, 5,75 %, 01-06-2019 pref C	3 250	459	690
				NextEra Energy Inc., 6,12 %, 01-09-2019 C	1 525	98	107
Produits industriels (5,29 %)				NextEra Energy Inc., 6,37 %, 01-09-2018 C	3 025	255	252
FANUC Corp.	2 000	427	501	T-Mobile US Inc., 5,05 %, 15-12-2017 pref C	2 000	181	256
International Consolidated Airlines Group SA	20 700	186	210	TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES PRIVILÉGIÉES		<u>2 084</u>	<u>2 408</u>
Komatsu Ltd.	8 300	263	274	TOTAL ACTIONS PRIVILÉGIÉES		<u>2 084</u>	<u>2 408</u>
Larsen & Toubro Ltd.	12 320	345	413	TOTAL ACTIONS		<u>16 162</u>	<u>19 614</u>
Schneider Electric SA	2 000	178	199				
		<u>1 399</u>	<u>1 597</u>	TOTAL DES PLACEMENTS (102,14 %)		<u>27 279</u>	<u>30 864</u>
				AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU			
Consommation discrétionnaire (2,21 %)				POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-2,14 %)			<u>(647)</u>
Daimler AG	4 500	439	424	TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE			<u>30 217</u>
Toyota Motor Corp.	3 600	232	245	COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			
		<u>671</u>	<u>669</u>				
Consommation de base (4,72 %)							
Anheuser-Busch InBev NV	2 075	287	297				
British American Tobacco PLC	2 790	203	246				
Diageo PLC	8 530	320	327				
Nestlé SA	2 055	174	232				
Unilever NV	4 520	264	324				
		<u>1 248</u>	<u>1 426</u>				
Soins de santé (0,93 %)							
Roche Holding AG	850	271	281				
Services financiers (5,86 %)							
AIA Group Ltd.	23 400	139	222				
BNP Paribas SA	2 325	186	217				
Credit Suisse Group AG	18 851	384	354				
Daiwa Securities Group Inc.	31 000	294	238				
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	41 300	371	360				
Prudential PLC	9 800	266	291				
UniCredit SpA	3 700	95	90				
		<u>1 735</u>	<u>1 772</u>				
Télécommunications (0,56 %)							
SoftBank Group Corp.	1 600	172	168				
Technologies de l'information (6,64 %)							
ASML Holding NV	950	171	161				
Samsung Electronics Co. Ltd.	80	157	216				
SAP SE	2 245	232	305				
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	54 000	189	480				
Temenos Group AG	2 250	194	261				
Tencent Holdings Ltd.	12 600	234	585				
		<u>1 177</u>	<u>2 008</u>				
TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		<u>7 690</u>	<u>8 903</u>				
TOTAL ACTIONS ORDINAIRES		<u>14 078</u>	<u>17 206</u>				

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Objectif du Fonds

Le Fonds SSQ Actions mondiales Calamos (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 et des obligations convertibles de sociétés mondiales de grande capitalisation majoritairement situées à l'extérieur du Canada. Le Fonds peut détenir des parts de fonds correspondant aux titres précités.

La stratégie d'investissement du gestionnaire externe, Calamos Investments, est de favoriser une approche de gestion descendante en mettant l'emphase sur des thèmes séculaires qui supporteront la croissance pour les décennies à venir. L'analyse fondamentale des entreprises est effectuée dans les industries où des thèmes intéressants ont été identifiés. Une sélection de titres est effectuée en analysant autant l'alternative d'investir dans les titres convertibles que le capital-actions. Les déviations sectorielles sont le fruit du processus ascendant de choix des titres.

Au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, l'actif du Fonds est principalement composé d'actions internationales et d'obligations convertibles de sociétés mondiales.

Risques présents

Le Fonds est exposé principalement au risque de crédit, au risque du marché incluant le risque du taux d'intérêt, 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

L'exposition du Fonds au risque de crédit découle des titres à revenu fixe.

Le tableau suivant présente la répartition des titres à revenu fixe détenus par le Fonds selon les cotes de crédit suivantes :

Cotes de crédit*	30 juin 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Cotés A	5,09	7,44
Cotés BBB	18,14	13,05
Cotés BB	7,92	4,32
Cotés B	13,87	8,35
Cotés CCC	-	1,36
Non cotés	54,98	65,48

* Source : Standard & Poor's

Risque de crédit (suite)

Toutes les transactions de titres négociables sont réglées ou payées à la livraison par l'intermédiaire de courtiers agréés. La livraison des titres vendus n'est exécutée que lorsque le courtier a reçu le paiement. Le paiement des achats n'est effectué que lorsque les titres ont été reçus par le courtier. La transaction échoue si l'une des parties ne remplit pas ses obligations.

Le Fonds peut participer à des opérations de prêts de titres. Au 30 juin 2017 des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 719 \$ (1 576 \$ au 31 décembre 2016) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 769 \$ (1 700 \$ au 31 décembre 2016).

De plus, au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, 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 titres à revenu fixe 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.

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

30 juin 2017	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	128	-	128
Autre créditeurs	16	-	16

31 décembre 2016	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	260	-	260
Autres créditeurs	32	-	32

Risque de taux d'intérêt

Le tableau suivant présente les échéances contractuelles des placements à leur juste valeur afin de refléter l'exposition du Fonds au risque de taux d'intérêt :

Placements au	Moins de 1 an (\$)	De 1 à 5 ans (\$)	Plus de 5 ans (\$)
30 juin 2017	353	9 210	1 687
31 décembre 2016	-	10 868	1 002

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Risque de taux d'intérêt (suite)

L'effet sur l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs du Fonds d'une variation des taux d'intérêt en vigueur serait :

Variation (%)	30 juin 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+1	(361)	(369)
-1	361	369

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

Risque de prix

Le Fonds effectue des transactions d'actions internationales et de titres à revenu fixe qui doivent rencontrer les exigences de la politique de placement.

L'actif du Fonds doit être investi dans au moins cinq pays de l'indice MSCI Monde. Le maximum investi dans un seul secteur sera généralement limité au plus élevé de 40 % ou de 2 fois le poids du secteur dans l'indice. Le pourcentage pouvant être affecté à une société est limité à 5 % 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 mondiales à grande capitalisation serait :

Variation (%)	30 juin 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
+ 5	1 543	1 770
- 5	(1 543)	(1 770)

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

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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
Couronne danoise	-	346
Dollar américain	19 564	24 391
Dollar de Hong Kong	1 144	977
Euro	4 748	4 458
Franc suisse	1 128	869
Livre sterling	1 267	1 284
Nouveau dollar de Taïwan	480	498
Yen japonais	2 317	2 112
Won sud-coréen	216	200
Total	30 864	35 135

Risque de change (suite)

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 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
Dollar canadien	+ 5	(1 543)	(1 757)
	- 5	1 543	1 757

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 2017 et au 31 décembre 2016, 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 2017 (%)	31 décembre 2016 (%)
Obligations canadiennes		
Sociétés	-	0,73
Obligations étrangères		
Sociétés	37,23	32,48
Actions américaines ordinaires		
Énergie	1,48	3,35
Matériaux de base	0,80	0,81
Produits industriels	0,59	3,24
Consommation discrétionnaire	1,91	2,79
Consommation de base	1,55	3,32
Soins de santé	5,28	3,58
Services financiers	5,43	8,37
Télécommunications	0,45	0,50
Technologies de l'information	9,99	12,33
Actions internationales ordinaires		
Énergie	1,88	1,70
Matériaux de base	1,37	0,80
Produits industriels	5,29	4,08
Consommation discrétionnaire	2,21	2,14
Consommation de base	4,72	3,58
Soins de santé	0,93	0,50
Services financiers	5,86	2,07
Télécommunications	0,56	0,57
Technologies de l'information	6,64	5,76
Actions américaines privilégiées	7,97	3,33
Actions internationales privilégiées	-	2,99
Autres éléments d'actif net	(2,14)	0,98
Total	100,00	100,00

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES CALAMOS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	11 250	-	11 250
Actions	19 614	-	-	19 614
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	19 614	11 250	-	30 684

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	11 870	-	11 870
Actions	23 524	-	-	23 524
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	23 524	11 870	-	35 394

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	29 653	23 484
Trésorerie	4 493	-
Cession de placements à recevoir	-	180
Autres débiteurs	-	11
Total de l'actif	34 146	23 675
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	182
Achat de placements à payer	4 500	-
Autres créditeurs	2	1
Total du passif	4 502	183
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	29 644	23 492
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,12	12,61
Classe B	12,80	12,40
Classe E	13,23	12,69
Classe F	13,07	12,59
Classe G	12,89	12,46
Classe I	13,95	13,17
Classe J	13,95	13,17
Classe L	11,38	10,74
Classe N	13,22	12,68

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	114	2
Non réalisé(e) sur les placements	586	480
Total gain net (perte nette)	700	482
Distributions par le fonds sous-jacent	504	-
	1 204	482
Charges		
Frais de gestion (note 6)	328	321
Frais d'administration	9	9
Frais de transactions	-	-
	337	330
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	867	152
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,43	0,05
Classe B	0,33	(0,04)
Classe E	0,46	0,08
Classe F	0,41	0,04
Classe G	0,35	(0,01)
Classe I	0,71	0,28
Classe J	0,71	0,29
Classe L	0,58	0,25
Classe N	0,46	0,08

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	23 492	18 471
Opérations sur les parts		
Parts émises	11 366	9 117
Parts rachetées	(6 081)	(4 176)
	5 285	4 941
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	867	152
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	29 644	23 564

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	867	152
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(700)	(482)
Distributions par le fonds sous-jacent	(504)	-
	(337)	(330)
Transactions de placements		
Acquisitions	(7 665)	(4 620)
Cessions	2 700	100
	(4 965)	(4 520)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	4 692	204
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(610)	(4 646)
Financement		
Parts émises	11 366	9 117
Parts rachetées	(6 081)	(4 176)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	5 285	4 941
Variation nette de la trésorerie	4 675	295
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(182)	(264)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	4 493	31
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,03 %)			
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	2 068 852	28 231	29 653
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,03 %)			(9)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			29 644

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD</i>	%
BCE Inc.	1,93
Welltower Inc.	1,90
Vodafone Group PLC	1,90
PPL Corp.	1,84
Imperial Brands PLC	1,80
Altria Group Inc.	1,74
Duke Energy Corp.	1,72
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG	1,65
Verizon Communications Inc.	1,64
AT&T Inc.	1,63

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	29 653	-	-	29 653
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	29 653	-	-	29 653

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	23 484	-	-	23 484
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	23 484	-	-	23 484

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	25 693	24 766
Trésorerie	479	18
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	26 172	24 784
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	255	-
Autres créditeurs	11	11
Total du passif	266	11
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	25 906	24 773
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,73	10,53
Classe B	11,56	10,45
Classe E	11,80	10,56
Classe F	11,71	10,52
Classe G	11,60	10,47
Classe I	12,24	10,77
Classe J	12,29	10,81
Classe N	11,79	10,56

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	349	-
Non réalisé(e) sur les placements	2 338	63
Total gain net (perte nette)	2 687	63
Distributions par le fonds sous-jacent	270	76
	2 957	139
Charges		
Frais de gestion (note 6)	108	7
Frais d'administration	3	-
Frais de transactions	-	-
	111	7
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 846	132
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,15	0,28
Classe B	1,06	0,28
Classe E	1,19	0,29
Classe F	1,14	0,28
Classe G	1,08	0,28
Classe I	1,46	0,31
Classe J	1,42	0,35
Classe N	1,18	0,29

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	24 773	-
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 836	18 673
Parts rachetées	(6 549)	(38)
	(1 713)	18 635
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 846	132
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	25 906	18 767

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 846	132
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 687)	(63)
Distributions par le fonds sous-jacent	(270)	(76)
	(111)	(7)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 030)	(18 330)
Cessions	5 060	68
	2 030	(18 262)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	255	10 786
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	2 174	(7 483)
Financement		
Parts émises	4 836	18 673
Parts rachetées	(6 549)	(38)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 713)	18 635
Variation nette de la trésorerie	461	11 152
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	18	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	479	11 152
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,18 %)			
Fonds Fiera Actions mondiales, Série A	1 349 365	22 342	25 693
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,82 %)			213
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			25 906

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Fiera Actions mondiales, Série A</i>	%
Moody's Corp.	5,05
Keyence Corp.	4,50
Johnson & Johnson	4,34
Becton Dickinson and Co.	3,89
Mastercard Inc., Classe A	3,85
Nestlé SA	3,46
Unilever NV	3,27
3M Company	3,15
US Bancorp	3,04
The Sherwin - Williams Co.	2,97

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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, Série 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	25 693	-	-	25 693
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	25 693	-	-	25 693

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	24 766	-	-	24 766
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	24 766	-	-	24 766

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES COUVERTES SUR LES DEVISES HEXAVEST

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	41 219	43 015
Trésorerie	1 034	-
Cession de placements à recevoir	-	1 935
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	42 253	44 950
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	1 762
Achat de placements à payer	600	-
Autres créditeurs	35	45
Total du passif	635	1 807
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 618	43 143
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,47	15,08
Classe B	15,15	14,86
Classe E	15,60	15,17
Classe F	15,40	15,03
Classe G	15,20	14,89
Classe I	16,53	15,80
Classe J	16,53	15,80
Classe N	15,59	15,16

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES COUVERTES SUR LES DEVISES HEXAVEST

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(429)	(121)
Non réalisé(e) sur les placements	2 453	3 229
Total gain net (perte nette)	2 024	3 108
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	2 024	3 108
Charges		
Frais de gestion (note 6)	149	114
Frais d'administration	3	3
Frais de transactions	-	-
	152	117
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 872	2 991
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,40	0,74
Classe B	0,30	0,65
Classe E	0,44	0,79
Classe F	0,38	0,73
Classe G	0,31	0,66
Classe I	0,75	1,04
Classe J	0,75	1,03
Classe N	0,44	0,79

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES COUVERTES SUR LES DEVISES HEXAVEST

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	43 143	35 044
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 414	11 029
Parts rachetées	(7 811)	(2 526)
	(3 397)	8 503
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 872	2 991
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	41 618	46 538

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 872	2 991
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 024)	(3 108)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(152)	(117)
Transactions de placements		
Acquisitions	(600)	(8 920)
Cessions	4 420	1 025
	3 820	(7 895)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2 525	(1 099)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	6 193	(9 111)
Financement		
Parts émises	4 414	11 029
Parts rachetées	(7 811)	(2 526)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 397)	8 503
Variation nette de la trésorerie	2 796	(608)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(1 762)	1 146
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	1 034	538
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES COUVERTES SUR LES DEVISES HEXAVEST

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,04 %)			
Fonds Hexavest Mondial, Classe B	41 417	45 246	41 219
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,96 %)			399
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			41 618

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Hexavest Mondial, Classe B</i>	%
Apple Inc.	2,79
Johnson & Johnson	1,95
Pfizer Inc.	1,76
AT&T Inc.	1,49
Verizon Communications Inc.	1,48
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	1,43
Wal-Mart Stores Inc.	1,34
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	1,19
Mizuho Financial Group Inc.	1,17
Cisco Systems Inc.	1,06

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES COUVERTES SUR LES DEVISES HEXAVEST

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales couvertes sur les devises Hexavest est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Hexavest Mondial, Classe B. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales couvertes sur les devises Hexavest 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 Hexavest Gestion d'actifs 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 valeur. Il met l'accent sur les facteurs macroéconomiques tout en utilisant une stratégie basée sur la recherche fondamentale et supportée par des modèles quantitatifs.

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	41 219	-	-	41 219
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	41 219	-	-	41 219

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	43 015	-	-	43 015
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	43 015	-	-	43 015

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES TOUS PAYS HEXAVEST

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	78 303	69 643
Trésorerie	189	87
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	78 492	69 730
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	34	30
Total du passif	34	30
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	78 458	69 700
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,54	10,27
Classe B	10,44	10,25
Classe E	10,57	10,27
Classe F	10,52	10,26
Classe G	10,47	10,25
Classe I	10,78	10,31
Classe J	19,07	18,24
Classe N	18,02	17,51

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES TOUS PAYS HEXAVEST

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(119)	(99)
Non réalisé(e) sur les placements	2 938	962
Total gain net (perte nette)	2 819	863
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
	2 819	864
Charges		
Frais de gestion (note 6)	16	6
Frais d'administration	-	-
Frais de transactions	4	2
	20	8
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 799	856
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,22	-
Classe B	0,13	-
Classe E	0,25	-
Classe F	0,20	-
Classe G	0,16	-
Classe I	0,42	-
Classe J	0,73	-
Classe N	0,41	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES TOUS PAYS HEXAVEST

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	69 700	53 943
Opérations sur les parts		
Parts émises	11 042	7 105
Parts rachetées	(5 083)	(3 999)
	5 959	3 106
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 799	856
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	78 458	57 905

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 799	856
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 819)	(863)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(20)	(7)
Transactions de placements		
Acquisitions	(8 340)	(5 410)
Cessions	2 499	2 638
	(5 841)	(2 772)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	4	3 298
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(5 857)	519
Financement		
Parts émises	11 042	7 105
Parts rachetées	(5 083)	(3 999)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	5 959	3 106
Variation nette de la trésorerie	102	3 625
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	87	72
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	189	3 697
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES TOUS PAYS HEXAVEST

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,80 %)			
Fonds Hexavest Mondial tous les pays	78 423	81 090	78 303
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,20 %)			155
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			78 458

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fonds Hexavest Mondial tous les pays</i>	%
Apple Inc.	2,39
Johnson & Johnson	1,68
Pfizer Inc.	1,52
Mitsubishi UFJ Financial Group Inc.	1,41
AT&T Inc.	1,28
Verizon Communications Inc.	1,28
Sumitomo Mitsui Financial Group Inc.	1,17
Mizuho Financial Group Inc.	1,16
Wal-Mart Stores Inc.	1,15
Nestlé SA	1,09

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES TOUS PAYS HEXAVEST

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales tous pays Hexavest est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent sous-jacent Hexavest Mondial tous les pays. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales tous pays Hexavest 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 Hexavest Gestion d'actifs selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement du gestionnaire est de favoriser une approche descendante 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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	78 303	-	-	78 303
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	78 303	-	-	78 303

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	69 643	-	-	69 643
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	69 643	-	-	69 643

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION LAZARD

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

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	30 juin 2017	31 décembre 2016
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	65 963	64 765
Trésorerie	1 443	-
Cession de placements à recevoir	-	2 405
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	67 406	67 170
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	2 269
Achat de placements à payer	1 410	-
Autres créditeurs	29	35
Total du passif	1 439	2 304
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	65 967	64 866
Valeur liquidative, par part		
Classe A	21,35	20,85
Classe B	20,92	20,56
Classe E	21,54	20,98
Classe F	21,23	20,77
Classe G	20,94	20,57
Classe I	22,76	21,80
Classe J	22,76	21,80
Classe N	21,52	20,97

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION 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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	470	242
Non réalisé(e) sur les placements	2 378	(5 648)
Total gain net (perte nette)	2 848	(5 406)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	2 848	(5 406)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	284	325
Frais d'administration	7	8
Frais de transactions	-	-
	291	333
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 557	(5 739)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,51	(2,32)
Classe B	0,37	(2,44)
Classe E	0,57	(2,28)
Classe F	0,47	(2,37)
Classe G	0,38	(2,44)
Classe I	0,98	(1,97)
Classe J	0,97	(1,98)
Classe N	0,56	(2,29)

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION 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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	64 866	58 217
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 481	14 966
Parts rachetées	(7 937)	(7 935)
	(1 456)	7 031
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 557	(5 739)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	65 967	59 509

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 557	(5 739)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 848)	5 406
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(291)	(333)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 410)	(7 940)
Cessions	3 060	3 147
	1 650	(4 793)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	3 809	4 710
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	5 168	(416)
Financement		
Parts émises	6 481	14 966
Parts rachetées	(7 937)	(7 935)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 456)	7 031
Variation nette de la trésorerie	3 712	6 615
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(2 269)	357
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	1 443	6 972
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION LAZARD

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,99 %)			
Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund	2 406 467	56 094	65 963
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,01 %)			4
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			65 967

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Lazard Global Small Cap Equity (Canada) Fund</i>	%
RPC Group Plc	1,86
TechnoPro Holdings Inc.	1,73
Aalberts Industries NV	1,66
Intertape Polymer Group Ltd	1,51
Innospec Inc.	1,50
Savills Plc	1,47
Aroundtown Property Holdings PLC	1,46
Rightmove PLC	1,45
Atkore International Group Inc.	1,45
Jafco Co Ltd	1,43

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION LAZARD

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (non auditées)
Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Lazard est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Lazard Global Small Cap Equity (Canada). Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation 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 diversifié avec un biais valeur. Le gestionnaire utilise une approche de gestion quantitative pour une première sélection de titres et par la suite fondamentale en privilégiant des entreprises de bonne qualité et bien gérées.

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	65 963	-	-	65 963
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	65 963	-	-	65 963

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	64 765	-	-	64 765
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	64 765	-	-	64 765

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	99 080	86 213
Trésorerie	100	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	99 180	86 213
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	806
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	75	89
Total du passif	75	895
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	99 105	85 318
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,11	11,23
Classe B	12,71	10,99
Classe E	13,23	11,30
Classe F	13,03	11,17
Classe G	12,86	11,08
Classe I	14,09	11,81
Classe J	13,90	11,65
Classe N	13,04	11,14

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	913	435
Non réalisé(e) sur les placements	15 507	(3 201)
Total gain net (perte nette)	16 420	(2 766)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	16 420	(2 766)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	75	15
Frais d'administration	2	-
Frais de transactions	-	-
	77	15
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	16 343	(2 781)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,89	(0,60)
Classe B	1,71	(0,67)
Classe E	1,95	(0,56)
Classe F	1,89	(0,61)
Classe G	1,78	(0,64)
Classe I	2,31	(0,36)
Classe J	2,26	(0,35)
Classe N	1,89	(0,55)

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	85 318	86 939
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 646	8 544
Parts rachetées	(7 202)	(10 097)
	(2 556)	(1 553)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	16 343	(2 781)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	99 105	82 605

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	16 343	(2 781)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(16 420)	2 766
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(77)	(15)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 240)	(6 035)
Cessions	4 793	8 165
	3 553	2 130
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(14)	24
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 462	2 139
Financement		
Parts émises	4 646	8 544
Parts rachetées	(7 202)	(10 097)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(2 556)	(1 553)
Variation nette de la trésorerie	906	586
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(806)	(493)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	100	93
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,97 %)			
Fisher Investments Emerging Markets Equity Unit Trust Fund	7 274 653	76 227	99 080
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,03 %)			25
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			99 105

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Fisher Investments Emerging Markets Equity Unit Trust Fund</i>	%
Samsung Electronics Co. Ltd.	5,00
Tencent Holdings Ltd.	5,00
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd.	4,70
Alibaba Group Holding Ltd.	4,60
HDFC Bank Ltd.	4,10
SK Hynix Inc.	3,50
Ctrip.com International Ltd. - ADR	3,10
NAVER Corp.	3,10
JD.com Inc	2,60
Infosys Ltd.	2,30

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	99 080	-	99 080
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	-	99 080	-	99 080

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	86 213	-	86 213
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	-	86 213	-	86 213

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	82 899	80 334
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	1 270	2 210
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	84 169	82 544
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	995	1 995
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	30	32
Total du passif	1 025	2 027
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	83 144	80 517
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,93	12,98
Classe B	14,71	12,85
Classe E	15,06	13,06
Classe F	14,84	12,93
Classe I	15,93	13,59
Classe J	15,93	13,58
Classe N	15,05	13,05

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2 120	206
Non réalisé(e) sur les placements	11 235	1 328
Total gain net (perte nette)	13 355	1 534
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	13 355	1 534
Charges		
Frais de gestion (note 6)	394	314
Frais d'administration	11	8
Frais de transactions	-	-
	405	322
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	12 950	1 212
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,96	0,02
Classe B	1,89	(0,03)
Classe E	2,03	0,06
Classe F	1,94	-
Classe I	2,39	0,27
Classe J	2,37	0,27
Classe N	2,01	0,05

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	80 517	69 505
Opérations sur les parts		
Parts émises	9 202	10 014
Parts rachetées	(19 525)	(7 095)
	(10 323)	2 919
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	12 950	1 212
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	83 144	73 636

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	12 950	1 212
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(13 355)	(1 534)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(405)	(322)
Transactions de placements		
Acquisitions	(470)	(3 565)
Cessions	11 260	990
	10 790	(2 575)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	938	997
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	11 323	(1 900)
Financement		
Parts émises	9 202	10 014
Parts rachetées	(19 525)	(7 095)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(10 323)	2 919
Variation nette de la trésorerie	1 000	1 019
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(1 995)	213
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	(995)	1 232
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,71 %)			
Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund	3 651 086	64 249	82 899
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,29 %)			245
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			83 144

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>Lazard Global Listed Infrastructure (Canada) Fund</i>	%
Abertis Infraestructuras SA	8,38
Atlantia SpA	7,97
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA	7,92
Vinci SA	7,74
Snam SpA	7,72
Norfolk Southern Corp.	7,40
SES SA	5,37
Eutelsat Communications SA	4,93
Transurban Group	4,37
Union Pacific Corp.	4,06

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

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

Période terminée le 30 juin 2017 (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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	82 899	-	-	82 899
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	82 899	-	-	82 899

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	80 334	-	-	80 334
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	80 334	-	-	80 334

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL MORGAN STANLEY

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	2017	2016
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	42 682	53 355
Trésorerie	457	-
Cession de placements à recevoir	3 135	425
Autres débiteurs	3	1
Total de l'actif	46 277	53 781
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	390
Achat de placements à payer	3 135	-
Autres créditeurs	14	17
Total du passif	3 149	407
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	43 128	53 374
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,24	15,31
Classe B	14,88	15,05
Classe E	15,37	15,40
Classe F	15,14	15,23
Classe I	16,06	15,88
Classe J	16,06	15,88
Classe K	16,06	15,88
Classe N	15,37	15,40

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL MORGAN STANLEY

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	2017	2016
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	3 284	1 548
Non réalisé(e) sur les placements	(2 462)	(3 388)
Total gain net (perte nette)	822	(1 840)
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Écart de conversion sur la trésorerie	(7)	(7)
	815	(1 846)
Charges		
Frais de gestion (note 6)	123	122
Frais d'administration	4	4
Frais de transactions	-	-
	127	126
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	688	(1 972)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,01)	(0,72)
Classe B	(0,11)	(0,82)
Classe E	0,04	(0,68)
Classe F	(0,04)	(0,75)
Classe I	0,26	(0,48)
Classe J	0,26	(0,48)
Classe K	0,26	(0,48)
Classe N	0,03	(0,68)

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL MORGAN STANLEY

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	2017	2016
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de la période	53 374	60 526
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 944	7 851
Parts rachetées	(15 878)	(10 916)
	(10 934)	(3 065)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	688	(1 972)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de la période	43 128	55 489

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Périodes terminées les 30 juin	2017	2016
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	688	(1 972)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	7	7
Gain net (perte nette) réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(822)	1 840
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	(127)	(125)
Transactions de placements		
Acquisitions	(4 617)	(4 821)
Cessions	16 112	8 507
	11 495	3 686
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	420	(2)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	11 788	3 559
Financement		
Parts émises	4 944	7 851
Parts rachetées	(15 878)	(10 916)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(10 934)	(3 065)
Écart de conversion sur la trésorerie	(7)	(7)
Variation nette de la trésorerie	847	487
Trésorerie (découvert bancaire) au début de la période	(390)	(77)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de la période	457	410
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL MORGAN STANLEY

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (non audité)

Au 30 juin 2017 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (98,97 %)				
Real Estate Securities Global Best Ideas Fund	33,04	6 276 406	8 945	14 247
MSIF Global Real Estate Portfolio	65,93	1 966 051	25 134	28 435
TOTAL DES PLACEMENTS (98,97 %)			34 079	42 682
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (1,03 %)				446
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				43 128

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT

<i>MSIF Global Real Estate Portfolio</i>	%
Simon Property Group Inc.	7,53
Vornado Realty Trust	3,96
Public Storage	3,31
General Growth Properties Inc.	3,10
Boston Properties Inc.	3,07
Equity Residential Properties	2,52
Regency Centers Corp.	2,25
Sun Hung Kai Properties Ltd.	2,23
Mitsui Fudosan Co. Ltd.	2,12
Mitsubishi Estate Co. Ltd.	2,09

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL MORGAN STANLEY

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

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley est un fonds distinct qui investit exclusivement dans les fonds sous-jacents MS Real Estate Securities Global Best Ideas et MSIF Global Real Estate Portfolio. Par conséquent, le Fonds SSQ Immobilier mondial Morgan Stanley 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 Morgan Stanley Investment Management 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. Il procède à la répartition régionale en se concentrant sur les principaux critères régionaux dont l'évaluation relative, les fondamentaux de l'immobilier ainsi que les considérations démographiques et macro-économiques. Le gestionnaire procède au choix des titres par une analyse fondamentale, en mettant l'emphase sur la valeur des actifs sous-jacents.

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 2017				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	28 435	14 247	-	42 682
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	28 435	14 247	-	42 682

31 décembre 2016				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	35 670	17 685	-	53 355
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	35 670	17 685	-	53 355

Au cours de la période de six mois terminée le 30 juin 2017 et de l'exercice terminé le 31 décembre 2016, 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 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

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 « 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 à même ses autres actifs. Les Fonds ne sont pas des entités juridiques distinctes de la Société.

La publication des états financiers intermédiaires des Fonds a été approuvée par la direction de la Société le 14 septembre 2017.

Au 30 juin 2017, les Fonds présents sont :

Fonds	Gestionnaires	Début des activités
Marché monétaire Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	1 ^{er} décembre 1997
Trésorerie OGP	Optimum Gestion de Placements	25 septembre 2008
Obligations Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	16 juin 2009
Obligations OGP	Optimum Gestion de Placements	25 septembre 2008
Obligations PIMCO	PIMCO Canada	27 mai 2008
Obligations mondiales PIMCO	PIMCO Canada	13 janvier 2014
Obligations de sociétés CI Signature	Placements CI	21 novembre 2016
Indice obligataire BlackRock	BlackRock Asset Management	4 juillet 2005
Stratégie sécuritaire	Multiplés (page 45)	7 décembre 1998
Stratégie équilibrée	Multiplés (page 50)	1 ^{er} décembre 1997
Stratégie croissance	Multiplés (page 55)	7 décembre 1998
Stratégie audacieuse	Multiplés (page 60)	14 novembre 2005
Celestia sécuritaire	Multiplés (page 65)	22 septembre 2008
Celestia équilibré	Multiplés (page 70)	22 septembre 2008
Celestia croissance	Multiplés (page 75)	22 septembre 2008
Celestia audacieux	Multiplés (page 80)	22 septembre 2008
Portefeuille fondamental sécuritaire BlackRock	BlackRock Asset Management	17 septembre 2009
Portefeuille fondamental équilibré BlackRock	BlackRock Asset Management	17 septembre 2009
Portefeuille fondamental croissance BlackRock	BlackRock Asset Management	17 septembre 2009
Portefeuille fondamental audacieux BlackRock	BlackRock Asset Management	17 septembre 2009
Équilibré Power Dynamique	Fonds Dynamique	28 octobre 2011
Revenu mensuel sécuritaire Guardian	Guardian Capital LP	12 juin 2015
Revenu mensuel Guardian	Guardian Capital LP	12 juin 2015
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge	Placements CI	9 juin 2014
Revenu et croissance mondial CI Signature	Placements 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
Actions canadiennes Montrusco Bolton	Placements Montrusco Bolton	26 mai 2011
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 internationales Hexavest	Hexavest Gestion d'actifs	1 ^{er} décembre 1997
Actions internationales C WorldWide*	C WorldWide Asset Management	9 juin 2008
Indice international BlackRock	BlackRock Asset Management	4 juillet 2005
Actions mondiales Calamos	Calamos Investments	3 juin 2011
Actions mondiales dividendes TD	Gestion de Placements TD	13 janvier 2014
Actions mondiales Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	31 mars 2016
Actions mondiales couvertes sur les devises Hexavest	Hexavest Gestion d'actifs	1 ^{er} septembre 2009

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES (suite)

Fonds	Gestionnaires	Début des activités
Actions mondiales tous pays Hexavest	Hexavest Gestion d'actifs	26 septembre 2011
Actions mondiales à petite capitalisation Lazard	Lazard Asset Management	15 septembre 2010
Actions marchés émergents Fisher	Fisher Investments	21 juillet 2011
Infrastructures mondiales Lazard	Lazard Asset Management	12 juin 2007
Immobilier mondial Morgan Stanley	Morgan Stanley Investment Management	31 mars 2011

*Ce Fonds est géré par C WorldWide Asset Management depuis le 5 juin 2017, il était auparavant géré par Carnegie Asset Management.

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

Fermeture de Fonds

Les Fonds suivants ont été fermés et leurs actifs nets ont été transférés aux Fonds de destination listés ci-dessous, sauf si indication contraire des souscripteurs de parts :

Fonds fermés	Fonds de destination	Date de fermeture
Actions américaines MFS	Actions américaines Fiera Capital	10 juin 2016
Actions américaines Tradewinds	Actions américaines Beutel Goodman	10 juin 2016
Actions mondiales Lazard	Actions mondiales Fiera Capital	10 juin 2016
Actions marchés émergents fondamentales BlackRock	Actions marchés émergents Fisher	30 juin 2016
Matières premières CoreCommodity Management	Marché monétaire Fiera Capital	10 juin 2016

Participation dans les Fonds

SSQ Assurance, une filiale de la Société détient des parts dans certains Fonds SSQ. Le tableau suivant présente les justes valeurs des soldes des investissements de la filiale dans les Fonds concernés :

Fonds	30 juin 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
Stratégie équilibrée	9 781	8 682
Stratégie croissance	7 490	4 676
Stratégie sécuritaire	3 503	3 471
Stratégie audacieuse	5 824	5 024
Revenu mensuel sécuritaire Guardian	465	260
Revenu mensuel Guardian	324	285
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge	7 972	5 760
Revenu et croissance mondial CI Signature	10 688	9 119
Actions canadiennes dividendes Guardian	2 110	1 341
Actions mondiales dividendes TD	1 762	1 131

De plus, au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, les régimes de retraite offerts aux employés de la Société détenaient des parts des Fonds.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Mode de présentation

Les présents états financiers intermédiaires (les « états financiers ») ont été préparés sur la base des Normes internationales d'information financière (IFRS) conformément à la norme IAS 34 « Information financière intermédiaire », comme l'exigent les lois canadiennes sur les valeurs mobilières et le Conseil des normes comptables du Canada.

Utilisation d'estimations et jugements de la direction

La préparation d'états financiers exige que la direction ait recours à son jugement pour établir des estimations et à 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 afin de déterminer si l'activité des Fonds consiste à investir dans le but de bénéficier d'un rendement global aux fins de l'application de l'option de la juste valeur selon IAS 39 « Instruments financiers : Comptabilisation et évaluation ». Le jugement le plus important réside dans la détermination que certains placements sont détenus à des fins de transaction et que l'option de la juste valeur peut être appliquée aux placements qui ne sont pas détenus à de telles fins.

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. 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 - Classification

Lors de la comptabilisation initiale de leurs instruments financiers, les Fonds ont classés les actifs financiers dans l'une des catégories suivantes : à la juste valeur par le biais du résultat net et prêts et créances. La catégorie à la juste valeur par le biais du résultat net comprend les actifs financiers détenus à des fins de transactions et les actifs financiers désignés à la juste valeur par le biais du résultat net. Les Fonds ont classés les passifs financiers dans l'une des catégories suivantes : à la juste valeur par le biais du résultat net et passif financier 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.

Placements

Les placements incluent des actions, des obligations, des fonds de placement, des fonds négociés en Bourse ainsi que du marché monétaire et sont désignés à la juste valeur par le biais du résultat net puisqu'ils sont gérés et évalués selon la base de la juste valeur conformément à la stratégie d'investissement des Fonds.

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 incluent des contrats de change standardisés. Ces instruments financiers sont classés comme étant 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.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES (suite)

Parts des Fonds détenues par les souscripteurs

Les parts des Fonds détenues par les souscripteurs sont classées comme passifs financiers. Étant donné que les parts sont rachetables en tout temps, leur juste valeur correspond à leur valeur comptable, soit leur valeur de rachat.

Participations dans des entreprises associées, des coentreprises et des filiales

Comme les fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement, ceux-ci évaluent leurs filiales à la juste valeur. Les filiales constituent des entités sous le contrôle des Fonds. Les Fonds contrôlent une entité lorsqu'ils sont exposés ou qu'ils ont droit à des rendements variables sur leur investissement et qu'ils ont la capacité d'influer sur ces rendements du fait du pouvoir qu'ils détiennent sur l'entité. Les entreprises associées et les coentreprises sont des participations dans des entités sur lesquelles les Fonds exercent une influence notable ou un contrôle conjoint, et sont toutes désignées à la juste valeur par le biais du résultat net.

Trésorerie et découvert bancaire

La trésorerie et le découvert bancaire représentent les comptes bancaires. La trésorerie est classée comme prêts et créances alors que le découvert bancaire est classé comme passif financier au coût amorti. Ils sont comptabilisés 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 créditeurs. Ces autres éléments d'actif et de passif sont comptabilisés au coût amorti et sont classés respectivement comme prêts et créances et comme passif financier au coût amorti.

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 ou d'obligations du Canada ou d'une province canadienne. Afin d'assurer que la juste valeur des titres donnés en garantie est supérieur 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 de revenus « 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 d'attribution constituent les montants d'intérêt nominal reçus par les Fonds. Les Fonds n'amortissent pas les primes versées ou les escomptes reçues 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 ».

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 fiduciaires 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.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES (suite)

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 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.

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 (à savoir des prix) ou indirectement (à savoir des données dérivées de prix);
- 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.

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 par la moyenne pondérée des parts en circulation au cours de la période.

3. MODIFICATIONS DE MÉTHODES COMPTABLES FUTURES

IFRS 9, Instruments financiers

En juillet 2014, l'IASB a publié la version définitive de l'IFRS 9, « Instruments financiers », qui reflète toutes les étapes du projet portant sur les instruments financiers et remplace l'IAS 39 ainsi que toutes les versions antérieures de l'IFRS 9. La norme introduit de nouvelles dispositions touchant le classement et l'évaluation, la dépréciation et la comptabilité de couverture. L'IFRS 9 est en vigueur pour les exercices ouverts à compter du 1^{er} janvier 2018 et son application anticipée est permise. L'application rétrospective est requise, mais l'information comparative n'est pas obligatoire. Les Fonds évaluent actuellement l'incidence de l'IFRS 9 et n'ont adopté aucune partie de celle-ci.

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 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 2017 et 2016 :

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Marché monétaire Fiera Capital				
Classe A				
2017	229 419	35 076	(61 789)	202 706
2016	217 276	61 578	(61 182)	217 672
Classe B				
2017	54 482	50 194	(21 223)	83 453
2016	50 233	49 996	(36 669)	63 560
Classe C				
2017	27 721	5 268	(26 582)	6 407
2016	11 052	133	(133)	11 052

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Marché monétaire Fiera Capital (suite)				
Classe E				
2017	197 856	327 316	(299 641)	225 531
2016	116 507	265 103	(197 158)	184 452
Classe F				
2017	130 648	31 162	(145 024)	16 786
2016	27 679	50 105	(45 672)	32 112
Classe G				
2017	97 904	193 848	(114 061)	177 691
2016	158 391	80 569	(230 360)	8 600
Classe I				
2017	21 788	5 574	(5 575)	21 787
2016	19 341	2 725	(488)	21 578
Classe J				
2017	32 226	6 132	(12 906)	25 452
2016	646 524	616 319	(719 079)	543 764
Classe N				
2017	49 609	259 331	(261 550)	47 390
2016	52 443	14 825	(13 444)	53 824
Trésorerie OGP				
Classe A				
2017	266 191	55 167	(127 725)	193 633
2016	377 892	61 153	(106 711)	332 334
Classe B				
2017	163 370	52 658	(85 805)	130 223
2016	179 296	21 924	(46 553)	154 667
Classe C				
2017	12 556	254 819	(250 570)	16 805
2016	14 481	175	(1 104)	13 552
Classe E				
2017	824 611	597 453	(951 704)	470 360
2016	649 368	776 821	(779 940)	646 249
Classe F				
2017	288 419	51 033	(98 356)	241 096
2016	251 578	270 673	(223 158)	299 093
Classe G				
2017	140 209	136 939	(207 673)	69 475
2016	110 362	70 313	(77 792)	102 883
Classe I				
2017	262 346	6 764	(21 741)	247 369
2016	422 818	84 272	(118 138)	388 952
Classe J				
2017	623 742	221 861	(183 557)	662 046
2016	538 977	145 581	(13 584)	670 974
Classe K				
2017	3 577 753	62 505	(210 466)	3 429 792
2016	3 411 064	256 557	(222 008)	3 445 613
Classe N				
2017	99 116	119 322	(56 282)	162 156
2016	87 636	63 267	(26 668)	124 235
Obligations Fiera Capital				
Classe A				
2017	1 301 390	67 146	(235 448)	1 133 088
2016	1 277 495	59 418	(178 143)	1 158 770
Classe B				
2017	746 980	38 984	(142 839)	643 125
2016	976 647	58 191	(207 052)	827 786
Classe C				
2017	876 347	36 139	(436 671)	475 815
2016	921 715	14 346	(63 555)	872 506
Classe D				
2017	205 725	-	(21 861)	183 864
2016	220 491	277	(11 628)	209 140

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations Fiera Capital (suite)				
Classe E				
2017	1 629 180	526 015	(659 985)	1 495 210
2016	1 037 589	325 081	(266 498)	1 096 172
Classe F				
2017	269 317	67 721	(69 237)	267 801
2016	225 622	58 957	(49 118)	235 461
Classe G				
2017	308 272	38 513	(84 410)	262 375
2016	321 746	50 724	(62 722)	309 748
Classe H				
2017	109 632	5 841	(8 837)	106 636
2016	73 326	14 958	(2 886)	85 398
Classe I				
2017	191 957	24 238	(18 170)	198 025
2016	186 227	11 172	(9 156)	188 243
Classe J				
2017	10 973 106	979 328	(2 248 946)	9 703 488
2016	10 610 269	1 245 746	(503 452)	11 352 563
Classe K				
2017	12 240 914	372 975	(2 333 711)	10 280 178
2016	9 200 495	2 792 618	(411 641)	11 581 472
Classe N				
2017	277 647	6 153	(39 294)	244 506
2016	287 169	5 906	(16 136)	276 939
Obligations OGP				
Classe A				
2017	141 263	11 447	(12 593)	140 117
2016	132 379	28 634	(22 553)	138 460
Classe B				
2017	66 641	10 355	(22 349)	54 647
2016	91 173	42 443	(33 269)	100 347
Classe C				
2017	171 560	595	(65 487)	106 668
2016	201 326	15 391	(40 267)	176 450
Classe E				
2017	1 265 776	335 498	(365 534)	1 235 740
2016	434 142	456 040	(114 449)	775 733
Classe F				
2017	153 114	43 979	(41 271)	155 822
2016	86 273	61 658	(35 447)	112 484
Classe G				
2017	217 646	38 222	(48 820)	207 048
2016	170 741	87 952	(48 969)	209 724
Classe I				
2017	4 191	31 995	(622)	35 564
2016	4 253	-	(31)	4 222
Classe J				
2017	2 749 290	128 774	(339 652)	2 538 412
2016	2 781 180	99 123	(128 758)	2 751 545
Classe N				
2017	274 054	46 689	(53 457)	267 286
2016	250 745	36 136	(16 887)	269 994
Obligations PIMCO				
Classe A				
2017	557 425	27 270	(118 061)	466 634
2016	661 539	83 846	(113 401)	631 984
Classe B				
2017	449 800	26 251	(122 779)	353 272
2016	687 391	32 412	(188 802)	531 001
Classe C				
2017	1 549 783	37 848	(590 638)	996 993
2016	1 747 929	44 398	(146 024)	1 646 303

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

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 E				
2017	1 480 533	767 596	(796 012)	1 452 117
2016	1 099 454	539 609	(267 987)	1 371 076
Classe F				
2017	223 903	48 398	(52 587)	219 714
2016	173 394	83 055	(33 334)	223 115
Classe G				
2017	289 596	27 749	(87 437)	229 908
2016	317 486	58 003	(58 523)	316 966
Classe I				
2017	129 499	36 307	(69 586)	96 220
2016	109 483	10 790	(13 064)	107 209
Classe J				
2017	6 429 917	475 592	(633 588)	6 271 921
2016	5 486 315	1 482 328	(198 287)	6 770 356
Classe N				
2017	185 109	9 129	(53 407)	140 831
2016	171 641	17 724	(6 771)	182 594
Obligations mondiales PIMCO				
Classe A				
2017	120 894	47 121	(36 732)	131 283
2016	142 422	32 098	(44 117)	130 403
Classe B				
2017	76 514	30 534	(9 622)	97 426
2016	68 569	29 836	(10 240)	88 165
Classe C				
2017	67 131	3 447	(21 510)	49 068
2016	69 890	1 119	(3 557)	67 452
Classe E				
2017	581 115	534 888	(193 584)	922 419
2016	381 797	189 002	(100 028)	470 771
Classe F				
2017	130 241	51 042	(30 805)	150 478
2016	118 728	43 063	(28 242)	133 549
Classe G				
2017	55 560	76 492	(22 966)	109 086
2016	70 572	10 319	(27 511)	53 380
Classe I				
2017	583 333	259 384	(84 750)	757 967
2016	451 784	207 578	(112 186)	547 176
Classe J				
2017	328 618	6 258	(15 440)	319 436
2016	325 872	4 502	(18 442)	311 932
Classe N				
2017	120 082	71 612	(50 770)	140 924
2016	47 159	99 952	(30 752)	116 359
Obligations de sociétés CI Signature				
Classe A				
2017	18 348	58 414	(11 488)	65 274
2016	-	-	-	-
Classe B				
2017	895	42 367	(6 800)	36 462
2016	-	-	-	-
Classe E				
2017	191 423	969 739	(126 480)	1 034 682
2016	-	-	-	-
Classe F				
2017	12 372	79 283	(5 852)	85 803
2016	-	-	-	-
Classe G				
2017	1 017	142 130	(17 997)	125 150
2016	-	-	-	-

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations de sociétés CI Signature (suite)				
Classe I				
2017	625	40 772	(152)	41 245
2016	-	-	-	-
Classe J				
2017	625	-	-	625
2016	-	-	-	-
Classe N				
2017	625	116 661	(5 388)	111 898
2016	-	-	-	-
Indice obligataire BlackRock				
Classe A				
2017	60 621	1 606	(9 786)	52 441
2016	71 895	2 049	(11 228)	62 716
Classe B				
2017	37 463	10 465	(17 559)	30 369
2016	45 227	1 412	(7 768)	38 871
Classe C				
2017	38 358	15	(15 430)	22 943
2016	42 975	855	(3 656)	40 174
Classe E				
2017	62 549	12 108	(23 432)	51 225
2016	34 619	45 258	(22 694)	57 183
Classe F				
2017	20 083	10 624	(1 608)	29 099
2016	16 324	3 281	(5 429)	14 176
Classe G				
2017	26 360	7 293	(3 132)	30 521
2016	19 914	2 842	(312)	22 444
Classe I				
2017	88	-	-	88
2016	88	-	-	88
Classe J				
2017	4 051 715	419 580	(528 614)	3 942 681
2016	4 228 165	506 067	(871 059)	3 863 173
Classe N				
2017	50 908	526	(4 742)	46 692
2016	66 868	588	(14 158)	53 298
Stratégie sécuritaire				
Classe A				
2017	1 592 123	132 036	(286 815)	1 437 344
2016	1 793 594	120 193	(260 566)	1 653 221
Classe B				
2017	1 146 573	85 197	(150 027)	1 081 743
2016	1 294 501	94 662	(200 158)	1 189 005
Classe C				
2017	1 442 253	60 084	(621 856)	880 481
2016	1 639 907	41 605	(172 792)	1 508 720
Classe E				
2017	2 363 452	771 533	(609 125)	2 525 860
2016	1 515 123	619 968	(293 013)	1 842 078
Classe F				
2017	414 078	140 801	(127 655)	427 224
2016	307 531	152 343	(84 341)	375 533
Classe G				
2017	1 085 095	472 499	(349 780)	1 207 814
2016	938 430	232 736	(146 702)	1 024 464
Classe I				
2017	50 017	110 967	(51 987)	108 997
2016	45 798	381	(1 565)	44 614
Classe J				
2017	84	-	-	84
2016	84	-	-	84

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

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 L				
2017	306 698	14 454	(21 403)	299 749
2016	262 801	10 066	(7 932)	264 935
Classe N				
2017	231 581	5 535	(61 169)	175 947
2016	305 615	20 424	(64 781)	261 258
Stratégie équilibrée				
Classe A				
2017	3 048 267	287 307	(473 068)	2 862 506
2016	3 791 658	249 685	(621 676)	3 419 667
Classe B				
2017	2 028 209	143 907	(301 578)	1 870 538
2016	2 263 436	215 316	(351 930)	2 126 822
Classe C				
2017	5 181 831	210 290	(2 673 431)	2 718 690
2016	5 809 601	42 801	(333 941)	5 518 461
Classe E				
2017	3 231 364	1 629 847	(986 865)	3 874 346
2016	3 044 384	1 074 360	(582 976)	3 535 768
Classe F				
2017	753 602	411 170	(209 104)	955 668
2016	506 148	213 035	(70 218)	648 965
Classe G				
2017	1 441 798	714 745	(536 717)	1 619 826
2016	1 364 385	226 135	(204 706)	1 385 814
Classe I				
2017	47 592	14 797	(4 664)	57 725
2016	59 189	700	(42 678)	17 211
Classe J				
2017	1 423 560	154 009	(74 190)	1 503 379
2016	1 273 665	176 638	(77 468)	1 372 835
Classe L				
2017	737 691	82 932	(15 016)	805 607
2016	580 000	64 421	(14 916)	629 505
Classe N				
2017	1 350 499	148 052	(158 696)	1 339 855
2016	1 394 536	55 565	(97 365)	1 352 736
Stratégie croissance				
Classe A				
2017	780 088	75 121	(90 390)	764 819
2016	883 910	46 047	(102 451)	827 506
Classe B				
2017	317 240	59 380	(47 494)	329 126
2016	345 781	30 722	(50 224)	326 279
Classe C				
2017	1 792 755	21 786	(854 577)	959 964
2016	1 990 700	35 367	(144 943)	1 881 124
Classe E				
2017	553 118	261 592	(147 209)	667 501
2016	461 372	155 760	(87 102)	530 030
Classe F				
2017	81 017	109 008	(64 372)	125 653
2016	61 731	22 576	(10 819)	73 488
Classe G				
2017	212 676	50 948	(31 704)	231 920
2016	195 986	16 609	(31 956)	180 639

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non audités)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie croissance (suite)				
Classe I				
2017	16 133	184	(454)	15 863
2016	16 869	214	(487)	16 596
Classe J				
2017	74	-	-	74
2016	74	-	-	74
Classe L				
2017	386 605	223 842	(13 338)	597 109
2016	212 918	35 713	-	248 631
Classe N				
2017	312 718	21 634	(25 119)	309 233
2016	304 632	24 988	(17 726)	311 894
Stratégie audacieuse				
Classe A				
2017	158 302	15 877	(31 498)	142 681
2016	182 212	13 347	(28 000)	167 559
Classe B				
2017	73 832	3 229	(20 894)	56 167
2016	75 850	17 960	(15 113)	78 697
Classe C				
2017	1 317 950	407 258	(493 242)	1 231 966
2016	1 471 355	8 425	(98 478)	1 381 302
Classe E				
2017	174 310	62 533	(44 408)	192 435
2016	132 730	51 983	(30 796)	153 917
Classe F				
2017	43 892	37 143	(25 604)	55 431
2016	32 268	14 052	(3 196)	43 124
Classe G				
2017	71 642	47 754	(31 054)	88 342
2016	57 100	46 597	(36 106)	67 591
Classe I				
2017	3 274	191	(2 527)	938
2016	7 324	2 482	(6 494)	3 312
Classe J				
2017	78	-	-	78
2016	78	-	-	78
Classe L				
2017	401 282	54 436	(7 583)	448 135
2016	342 418	58 674	(11 045)	390 047
Classe N				
2017	26 111	37 327	(1 264)	62 174
2016	20 526	7 767	(2 569)	25 724
Celestia sécuritaire				
Classe A				
2017	942 869	61 001	(212 396)	791 474
2016	1 154 106	110 168	(235 774)	1 028 500
Classe B				
2017	352 159	33 932	(83 562)	302 529
2016	433 046	36 368	(83 437)	385 977
Classe C				
2017	1 489 486	49 565	(685 198)	853 853
2016	1 488 885	111 946	(80 476)	1 520 355

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Celestia sécuritaire (suite)				
Classe E				
2017	2 843 325	1 294 121	(731 293)	3 406 153
2016	2 365 869	890 956	(748 644)	2 508 181
Classe F				
2017	950 162	160 781	(119 462)	991 481
2016	593 195	248 719	(109 606)	732 308
Classe G				
2017	778 036	96 710	(122 006)	752 740
2016	777 029	133 948	(140 480)	770 497
Classe I				
2017	286 036	146 876	(97 489)	335 423
2016	282 955	24 785	(17 977)	289 763
Classe J				
2017	84	-	-	84
2016	84	-	-	84
Classe N				
2017	96 503	33 103	(24 862)	104 744
2016	74 501	9 259	(9 258)	74 502
Celestia équilibré				
Classe A				
2017	1 514 661	147 333	(316 881)	1 345 113
2016	1 706 456	143 071	(218 552)	1 630 975
Classe B				
2017	770 919	60 611	(169 267)	662 263
2016	818 404	72 444	(116 009)	774 839
Classe C				
2017	3 473 190	80 256	(1 586 083)	1 967 363
2016	3 856 607	109 246	(299 734)	3 666 119
Classe E				
2017	3 390 715	1 472 086	(823 298)	4 039 503
2016	2 611 933	826 243	(502 879)	2 935 297
Classe F				
2017	1 458 600	335 396	(342 583)	1 451 413
2016	1 183 212	323 449	(137 338)	1 369 323
Classe G				
2017	1 052 824	304 734	(311 536)	1 046 022
2016	828 740	254 425	(100 631)	982 534
Classe I				
2017	39 994	71 041	(32 255)	78 780
2016	32 997	6 762	(1 164)	38 595
Classe J				
2017	82	-	-	82
2016	82	-	-	82
Classe N				
2017	728 520	50 187	(55 613)	723 094
2016	759 254	58 809	(89 200)	728 863
Celestia croissance				
Classe A				
2017	340 925	27 632	(67 569)	300 988
2016	408 333	29 552	(89 457)	348 428
Classe B				
2017	196 739	166 848	(119 172)	244 415
2016	208 208	103 314	(113 369)	198 153
Classe C				
2017	2 131 194	70 665	(988 099)	1 213 760
2016	2 330 590	61 372	(154 346)	2 237 616

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Celestia croissance (suite)				
Classe E				
2017	1 155 187	461 766	(268 054)	1 348 899
2016	834 913	319 063	(132 024)	1 021 952
Classe F				
2017	418 332	117 201	(124 888)	410 645
2016	307 696	154 043	(63 465)	398 274
Classe G				
2017	299 870	228 882	(91 747)	437 005
2016	252 896	37 616	(34 268)	256 244
Classe I				
2017	35 446	38 704	(29 122)	45 028
2016	51 412	35 511	(47 122)	39 801
Classe J				
2017	79	-	-	79
2016	79	-	-	79
Classe N				
2017	176 438	13 197	(15 695)	173 940
2016	174 090	14 001	(12 862)	175 229
Celestia audacieux				
Classe A				
2017	138 145	11 235	(32 077)	117 303
2016	163 131	10 636	(28 696)	145 071
Classe B				
2017	68 732	10 236	(16 901)	62 067
2016	112 129	40 549	(78 310)	74 368
Classe C				
2017	1 238 971	452 025	(554 706)	1 136 290
2016	1 509 970	9 215	(159 910)	1 359 275
Classe D				
2017	230 127	688	(30 468)	200 347
2016	294 751	3 087	(44 951)	252 887
Classe E				
2017	420 613	257 819	(224 043)	454 389
2016	345 902	113 869	(82 184)	377 587
Classe F				
2017	94 380	76 676	(41 400)	129 656
2016	85 966	9 239	(5 352)	89 853
Classe G				
2017	255 917	127 309	(145 553)	237 673
2016	255 748	36 212	(25 994)	265 966
Classe H				
2017	240 958	18 695	(7 622)	252 031
2016	242 883	23 432	(23 403)	242 912
Classe I				
2017	76 242	17 107	(11 460)	81 889
2016	80 499	11 246	(12 287)	79 458
Classe J				
2017	79	-	-	79
2016	79	-	-	79
Classe N				
2017	115 612	8 806	(6 942)	117 476
2016	116 335	33 248	(34 136)	115 447
Portefeuille fondamental sécuritaire BlackRock				
Classe A				
2017	272 971	41 280	(59 077)	255 174
2016	315 371	28 995	(34 844)	309 522

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDOS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Portefeuille fondamental sécuritaire BlackRock (suite)				
Classe B				
2017	94 649	19 250	(32 115)	81 784
2016	108 454	10 675	(23 584)	95 545
Classe C				
2017	542 985	5 201	(195 861)	352 325
2016	575 743	18 278	(32 196)	561 825
Classe E				
2017	324 272	202 256	(79 107)	447 421
2016	254 712	37 259	(41 571)	250 400
Classe F				
2017	53 289	22 801	(15 528)	60 562
2016	37 542	5 853	(3 157)	40 238
Classe G				
2017	117 423	144 511	(113 471)	148 463
2016	100 164	41 837	(19 360)	122 641
Classe I				
2017	1 855	10 062	(73)	11 844
2016	83	786	-	869
Classe J				
2017	83	-	-	83
2016	83	-	-	83
Classe N				
2017	8 177	968	(1)	9 144
2016	32 603	332	(6)	32 929
Portefeuille fondamental équilibré BlackRock				
Classe A				
2017	333 076	31 480	(37 124)	327 432
2016	424 804	16 102	(71 701)	369 205
Classe B				
2017	258 946	38 013	(32 883)	264 076
2016	320 265	9 883	(52 673)	277 475
Classe C				
2017	1 680 004	68 332	(745 290)	1 003 046
2016	1 981 051	17 781	(142 040)	1 856 792
Classe E				
2017	386 879	390 906	(170 053)	607 732
2016	397 972	58 010	(77 819)	378 163
Classe F				
2017	305 060	159 044	(117 579)	346 525
2016	266 735	54 137	(48 591)	272 281
Classe G				
2017	351 440	221 283	(146 355)	426 368
2016	284 378	66 559	(25 343)	325 594
Classe I				
2017	23 910	31 780	(24 168)	31 522
2016	29 023	664	(3 487)	26 200
Classe J				
2017	80	-	-	80
2016	80	-	-	80
Classe N				
2017	6 043	937	(457)	6 523
2016	5 545	170	(5)	5 710
Portefeuille fondamental croissance BlackRock				
Classe A				
2017	230 509	31 990	(41 283)	221 216
2016	240 721	2 035	(9 521)	233 235

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDOS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Portefeuille fondamental croissance BlackRock (suite)				
Classe B				
2017	47 813	10 792	(24 790)	33 815
2016	67 978	1 542	(14 944)	54 576
Classe C				
2017	830 117	79 459	(410 092)	499 484
2016	985 786	6 718	(70 317)	922 187
Classe E				
2017	236 197	113 738	(69 674)	280 261
2016	237 068	38 105	(52 866)	222 307
Classe F				
2017	249 350	123 687	(66 114)	306 923
2016	200 504	43 885	(25 665)	218 724
Classe G				
2017	84 008	34 395	(24 287)	94 116
2016	71 765	7 924	(5 757)	73 932
Classe I				
2017	11 757	13 571	(15 342)	9 986
2016	14 036	-	(1 269)	12 767
Classe J				
2017	79	-	-	79
2016	79	-	-	79
Classe N				
2017	11 032	5 513	(2)	16 543
2016	10 835	245	(152)	10 928
Portefeuille fondamental audacieux BlackRock				
Classe A				
2017	105 942	5 665	(44 605)	67 002
2016	131 320	3 658	(16 252)	118 726
Classe B				
2017	202 801	25 690	(54 477)	174 014
2016	246 691	19 043	(56 847)	208 887
Classe C				
2017	734 989	45 968	(271 340)	509 617
2016	781 155	32 245	(54 295)	759 105
Classe E				
2017	104 441	108 036	(51 518)	160 959
2016	64 030	51 168	(17 460)	97 738
Classe F				
2017	9 126	42 282	(27 831)	23 577
2016	7 685	620	(834)	7 471
Classe G				
2017	47 653	54 545	(41 604)	60 594
2016	49 076	24	(2 271)	46 829
Classe I				
2017	77	6 419	(44)	6 452
2016	77	-	-	77
Classe J				
2017	77	-	-	77
2016	77	-	-	77
Classe N				
2017	1 257	883	(308)	1 832
2016	3 294	144	(14)	3 424
Équilibré Power Dynamique				
Classe A				
2017	127 804	2 952	(22 591)	108 165
2016	176 017	8 342	(31 244)	153 115

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Équilibré Power Dynamique (suite)				
Classe B				
2017	72 002	1 457	(7 427)	66 032
2016	105 223	3 011	(7 845)	100 389
Classe C				
2017	478 909	6 853	(275 140)	210 622
2016	585 659	3 521	(48 290)	540 890
Classe E				
2017	173 014	40 855	(68 716)	145 153
2016	190 664	23 387	(36 537)	177 514
Classe F				
2017	47 100	3 948	(8 914)	42 134
2016	81 597	19 368	(22 864)	78 101
Classe G				
2017	60 907	7 522	(16 089)	52 340
2016	78 174	6 779	(8 381)	76 572
Classe I				
2017	87	-	-	87
2016	2 930	87	(2 930)	87
Classe J				
2017	83	-	-	83
2016	83	-	-	83
Classe N				
2017	16 714	2 045	(942)	17 817
2016	18 340	614	(1)	18 953
Revenu mensuel sécuritaire Guardian				
Classe A				
2017	90 940	56 228	(36 204)	110 964
2016	12 060	98 665	(8 940)	101 785
Classe B				
2017	1 415	4 797	(3 857)	2 355
2016	911	482	(4)	1 389
Classe C				
2017	35 152	2 078	(10 763)	26 467
2016	280	9 705	(727)	9 258
Classe E				
2017	883 467	484 071	(223 287)	1 144 251
2016	220 891	541 713	(116 266)	646 338
Classe F				
2017	159 521	136 291	(62 609)	233 203
2016	114 022	66 544	(52 063)	128 503
Classe G				
2017	111 322	72 896	(46 257)	137 961
2016	33 934	49 899	(4 989)	78 844
Classe I				
2017	8 604	9 371	(5 152)	12 823
2016	103	8 457	(6)	8 554
Classe J				
2017	102	-	-	102
2016	102	-	-	102
Classe L				
2017	24 111	17 430	(1)	41 540
2016	100	-	-	100
Classe N				
2017	1 610	32	(1 192)	450
2016	1 116	51	-	1 167

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Revenu mensuel Guardian				
Classe A				
2017	68 431	62 056	(60 736)	69 751
2016	7 082	121 197	(22 513)	105 766
Classe B				
2017	9 187	36 132	(1 552)	43 767
2016	5 772	2 747	(1 604)	6 915
Classe C				
2017	201 298	129 772	(48 568)	282 502
2016	3 343	71 052	(5 111)	69 284
Classe E				
2017	716 832	777 631	(210 497)	1 283 966
2016	139 556	343 440	(71 959)	411 037
Classe F				
2017	401 328	405 043	(98 333)	708 038
2016	173 141	190 731	(40 599)	323 273
Classe G				
2017	204 608	134 674	(80 083)	259 199
2016	104 949	76 045	(15 726)	165 268
Classe I				
2017	64 300	34 148	(729)	97 719
2016	45 187	9 354	(457)	54 084
Classe J				
2017	102	-	-	102
2016	102	-	-	102
Classe L				
2017	25 968	2 443	-	28 411
2016	100	3 225	-	3 325
Classe N				
2017	106	12 625	(186)	12 545
2016	102	2	-	104
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge				
Classe A				
2017	3 047 526	368 761	(425 309)	2 990 978
2016	3 082 020	299 071	(334 418)	3 046 673
Classe B				
2017	2 146 430	182 323	(338 779)	1 989 974
2016	2 380 745	168 298	(304 580)	2 244 463
Classe C				
2017	6 172 130	519 420	(2 865 544)	3 826 006
2016	6 502 345	344 569	(457 217)	6 389 697
Classe E				
2017	3 953 215	2 270 134	(1 339 441)	4 883 908
2016	2 537 873	981 558	(521 553)	2 997 878
Classe F				
2017	1 307 091	734 058	(329 431)	1 711 718
2016	1 029 419	409 677	(120 514)	1 318 582
Classe G				
2017	1 463 007	403 312	(289 239)	1 577 080
2016	1 192 411	288 667	(101 361)	1 379 717
Classe I				
2017	95 383	105 021	(2 907)	197 497
2016	61 794	47 029	(40 886)	67 937
Classe J				
2017	127	-	-	127
2016	127	-	-	127

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge (suite)				
Classe L				
2017	470 108	172 998	(5 842)	637 264
2016	48 616	112 193	(3 038)	157 771
Classe N				
2017	206 828	42 518	(21 885)	227 461
2016	187 807	14 146	(7 936)	194 017
Revenu et croissance mondial CI Signature				
Classe A				
2017	1 319 784	327 630	(451 190)	1 196 224
2016	1 373 466	410 816	(303 678)	1 480 604
Classe B				
2017	1 364 797	56 785	(110 020)	1 311 562
2016	1 508 336	109 719	(116 953)	1 501 102
Classe C				
2017	3 073 626	243 488	(1 718 939)	1 598 175
2016	3 372 993	423 162	(395 606)	3 400 549
Classe E				
2017	6 573 433	2 767 800	(1 726 681)	7 614 552
2016	4 435 104	2 380 698	(867 654)	5 948 148
Classe F				
2017	2 011 265	1 053 525	(428 376)	2 636 414
2016	1 377 692	852 894	(258 521)	1 972 065
Classe G				
2017	1 379 296	594 474	(395 300)	1 578 470
2016	990 074	453 961	(166 559)	1 277 476
Classe I				
2017	147 571	187 154	(23 942)	310 783
2016	155 569	190 068	(169 442)	176 195
Classe J				
2017	152	-	-	152
2016	152	-	-	152
Classe L				
2017	713 012	97 441	(9 783)	800 670
2016	232 806	209 348	(4 801)	437 353
Classe N				
2017	282 185	63 757	(70 916)	275 026
2016	243 042	75 181	(54 410)	263 813
Actions canadiennes dividendes Guardian				
Classe A				
2017	705 950	57 011	(146 606)	616 355
2016	706 230	191 168	(157 116)	740 282
Classe B				
2017	509 638	53 502	(81 742)	481 398
2016	607 728	55 306	(106 550)	556 484
Classe E				
2017	1 027 570	441 780	(296 750)	1 172 600
2016	932 750	188 764	(187 722)	933 792
Classe F				
2017	331 513	187 024	(52 371)	466 166
2016	284 541	86 581	(66 636)	304 486
Classe G				
2017	2 318 264	1 128 720	(661 190)	2 785 794
2016	1 264 527	1 261 720	(564 330)	1 961 917

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDOS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions canadiennes dividendes Guardian (suite)				
Classe I				
2017	134 813	29 197	(13 556)	150 454
2016	84 866	6 570	(1 925)	89 511
Classe J				
2017	297 506	35 776	(24 693)	308 589
2016	286 743	34 345	(30 185)	290 903
Classe L				
2017	113 680	64 122	-	177 802
2016	2 901	13 711	(100)	16 512
Classe N				
2017	96 546	24 716	(7 566)	113 696
2016	60 224	26 890	(7 023)	80 091
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée				
Classe A				
2017	922 588	113 608	(151 554)	884 642
2016	1 123 212	105 832	(232 570)	996 474
Classe B				
2017	574 559	70 360	(100 645)	544 274
2016	682 119	56 820	(115 967)	622 972
Classe D				
2017	537 628	2 427	(41 979)	498 076
2016	631 928	1 550	(55 074)	578 404
Classe E				
2017	649 465	307 892	(157 183)	800 174
2016	496 538	174 225	(140 325)	530 438
Classe F				
2017	166 077	89 718	(40 037)	215 758
2016	96 428	57 478	(19 425)	134 481
Classe G				
2017	261 317	129 960	(66 562)	324 715
2016	257 832	39 746	(36 698)	260 880
Classe H				
2017	152 262	29 010	(18 172)	163 100
2016	129 606	42 372	(21 935)	150 043
Classe I				
2017	312 628	43 904	(25 150)	331 382
2016	335 870	85 836	(103 495)	318 211
Classe J				
2017	3 402 794	342 967	(490 119)	3 255 642
2016	3 878 041	399 687	(243 238)	4 034 490
Classe N				
2017	224 140	18 571	(27 105)	215 606
2016	229 792	37 433	(23 183)	244 042
Actions canadiennes Triasima				
Classe A				
2017	616 822	58 925	(157 279)	518 468
2016	789 166	44 562	(162 194)	671 534
Classe B				
2017	545 173	33 503	(89 820)	488 856
2016	658 637	46 159	(98 676)	606 120
Classe D				
2017	90 723	619	(5 006)	86 336
2016	94 940	102	(3 817)	91 225
Classe E				
2017	593 659	190 759	(180 199)	604 219
2016	612 276	155 334	(146 886)	620 724

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions canadiennes Triasima (suite)				
Classe F				
2017	263 016	86 181	(58 974)	290 223
2016	187 969	94 119	(50 179)	231 909
Classe G				
2017	244 978	108 160	(117 417)	235 721
2016	237 687	40 575	(38 978)	239 284
Classe H				
2017	56 829	3 108	(1 530)	58 407
2016	46 023	11 487	(663)	56 847
Classe I				
2017	127 568	61 221	(17 198)	171 591
2016	106 466	44 567	(35 341)	115 692
Classe J				
2017	8 924 831	666 221	(711 121)	8 879 931
2016	7 844 218	683 603	(464 138)	8 063 683
Classe K				
2017	5 025 338	206 141	(518 957)	4 712 522
2016	4 263 816	1 109 092	(253 679)	5 119 229
Classe N				
2017	266 795	13 010	(56 160)	223 645
2016	264 560	29 957	(22 043)	272 474
Actions canadiennes Montrusco Bolton				
Classe A				
2017	15 069	4 367	(3 454)	15 982
2016	12 130	1 703	(4 039)	9 794
Classe B				
2017	21 995	4 368	(6 329)	20 034
2016	12 514	5 650	(567)	17 597
Classe E				
2017	48 952	56 454	(22 256)	83 150
2016	13 917	10 589	(1 727)	22 779
Classe F				
2017	13 174	20 927	(1 435)	32 666
2016	8 511	1 027	(684)	8 854
Classe G				
2017	44 493	45 027	(23 954)	65 566
2016	22 794	4 892	(1 180)	26 506
Classe I				
2017	9 389	544	(1 254)	8 679
2016	9 989	497	(686)	9 800
Classe J				
2017	2 478 546	272 822	(49 975)	2 701 393
2016	3 362 281	299 265	(433 923)	3 227 623
Classe K				
2017	2 574 621	121 673	(204 105)	2 492 189
2016	4 664 643	11 174	(1 902 721)	2 773 096
Classe N				
2017	4 254	893	(136)	5 011
2016	3 527	762	(511)	3 778
Indice canadien BlackRock				
Classe A				
2017	76 143	4 165	(13 180)	67 128
2016	83 118	12 536	(17 646)	78 008
Classe B				
2017	289 548	12 513	(15 833)	286 228
2016	116 331	198 867	(21 069)	294 129

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice canadien BlackRock (suite)				
Classe D				
2017	348 895	629	(22 156)	327 368
2016	408 577	597	(35 713)	373 461
Classe E				
2017	56 615	30 066	(27 124)	59 557
2016	32 029	33 349	(26 134)	39 244
Classe F				
2017	31 031	24 629	(2 821)	52 839
2016	18 463	26 261	(25 981)	18 743
Classe G				
2017	48 235	16 019	(12 643)	51 611
2016	40 443	21 168	(14 617)	46 994
Classe H				
2017	120 939	10 401	(6 313)	125 027
2016	118 562	17 695	(12 476)	123 781
Classe I				
2017	26 923	1 363	(1 535)	26 751
2016	27 287	17 881	(18 063)	27 105
Classe J				
2017	138 555	380 291	(10 998)	507 848
2016	10 503	98 041	(8 937)	99 607
Classe N				
2017	43 245	4 121	(3 012)	44 354
2016	27 759	2 465	(387)	29 837
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital				
Classe A				
2017	298 152	47 514	(83 850)	261 816
2016	388 532	25 218	(89 819)	323 931
Classe B				
2017	205 092	18 461	(46 666)	176 887
2016	243 105	25 719	(50 826)	217 998
Classe E				
2017	300 046	138 155	(103 030)	335 171
2016	229 745	84 028	(44 941)	268 832
Classe F				
2017	177 118	77 022	(45 269)	208 871
2016	142 601	55 432	(43 741)	154 292
Classe G				
2017	130 806	37 164	(30 476)	137 494
2016	149 624	20 485	(30 486)	139 623
Classe I				
2017	28 027	8 890	(4 318)	32 599
2016	33 080	8 862	(7 680)	34 262
Classe J				
2017	843 143	130 400	(138 972)	834 571
2016	836 929	95 465	(46 505)	885 889
Classe N				
2017	78 611	16 014	(16 473)	78 152
2016	86 877	11 566	(10 374)	88 069
Actions américaines Hillsdale				
Classe A				
2017	11 357	10 481	(3 861)	17 977
2016	2 036	7 828	(880)	8 984
Classe B				
2017	10 983	6 718	(4 314)	13 387
2016	6 631	10 176	(3 795)	13 012

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions américaines Hillsdale (suite)				
Classe E				
2017	52 940	47 462	(19 545)	80 857
2016	16 944	50 209	(16 683)	50 470
Classe F				
2017	17 374	16 522	(6 207)	27 689
2016	3 858	12 783	(401)	16 240
Classe G				
2017	22 028	8 782	(7 867)	22 943
2016	13 072	14 939	(2 629)	25 382
Classe I				
2017	53	758	(1)	810
2016	641	63	(651)	53
Classe J				
2017	923 271	56 624	(31 653)	948 242
2016	1 251 787	179 671	(185 100)	1 246 358
Classe K				
2017	1 272 243	55 467	(199 372)	1 128 338
2016	1 670 200	270 340	(466 571)	1 473 969
Classe N				
2017	8 059	234	(2 003)	6 290
2016	7 760	2 282	(3 177)	6 865
Actions américaines Beutel Goodman				
Classe A				
2017	334 348	180 642	(95 163)	419 827
2016	2 784	382 581	(22 399)	362 966
Classe B				
2017	232 023	42 721	(60 443)	214 301
2016	2 055	264 422	(16 062)	250 415
Classe E				
2017	850 376	1 008 121	(274 053)	1 584 444
2016	27 531	802 860	(56 171)	774 220
Classe F				
2017	334 400	440 491	(85 546)	689 345
2016	12 491	301 749	(12 582)	301 658
Classe G				
2017	296 415	172 103	(53 933)	414 585
2016	8 973	316 576	(8 431)	317 118
Classe I				
2017	605	15 301	(11)	15 895
2016	4 904	11 722	(14 388)	2 238
Classe J				
2017	722	-	-	722
2016	625	97	-	722
Classe N				
2017	55 409	40 980	(14 038)	82 351
2016	625	66 505	(42)	67 088
Actions américaines Fiera Capital				
Classe A				
2017	682 340	75 663	(219 368)	538 635
2016	2 388	821 918	(24 061)	800 245
Classe B				
2017	408 572	31 646	(87 876)	352 342
2016	11 374	456 071	(11 009)	456 436
Classe D				
2017	406 946	3 882	(39 232)	371 596
2016	1 420	441 483	(4 277)	438 626
Classe E				
2017	910 516	215 727	(257 573)	868 670
2016	19 679	1 029 225	(59 134)	989 770

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDOS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions américaines Fiera Capital (suite)				
Classe F				
2017	358 241	69 235	(96 284)	331 192
2016	22 563	416 356	(24 389)	414 530
Classe G				
2017	681 895	63 241	(212 076)	533 060
2016	39 891	740 838	(20 122)	760 607
Classe H				
2017	318 444	23 215	(21 559)	320 100
2016	5 709	331 405	(5 957)	331 157
Classe I				
2017	111 981	7 313	(1 492)	117 802
2016	4 754	116 512	(4 911)	116 355
Classe J				
2017	196 416	201	(184 278)	12 339
2016	500	197 818	(854)	197 464
Classe N				
2017	239 426	29 501	(54 686)	214 241
2016	500	268 296	(327)	268 469
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital				
Classe A				
2017	710	15 903	(719)	15 894
2016	-	-	-	-
Classe B				
2017	845	266	(306)	805
2016	-	-	-	-
Classe E				
2017	35 881	212 910	(41 640)	207 151
2016	-	-	-	-
Classe F				
2017	4 396	25 194	(1 187)	28 403
2016	-	-	-	-
Classe G				
2017	27 336	27 508	(27 431)	27 413
2016	-	-	-	-
Classe I				
2017	625	48 596	(2 710)	46 511
2016	-	-	-	-
Classe J				
2017	625	-	-	625
2016	-	-	-	-
Classe N				
2017	625	1 231	-	1 856
2016	-	-	-	-
Indice américain BlackRock				
Classe A				
2017	414 383	43 843	(81 541)	376 685
2016	552 267	95 638	(196 150)	451 755
Classe B				
2017	172 578	19 035	(28 414)	163 199
2016	232 141	26 721	(59 237)	199 625
Classe D				
2017	271 736	1 684	(30 021)	243 399
2016	313 842	2 853	(25 477)	291 218
Classe E				
2017	853 980	261 182	(298 468)	816 694
2016	693 281	410 165	(274 542)	828 904
Classe F				
2017	409 180	50 785	(52 561)	407 404
2016	161 450	292 451	(44 871)	409 030
Classe G				
2017	262 392	43 221	(56 200)	249 413
2016	201 622	122 779	(40 204)	284 197

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

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 H				
2017	316 644	20 598	(7 329)	329 913
2016	305 795	25 923	(7 925)	323 793
Classe I				
2017	369 216	76 351	(60 670)	384 897
2016	466 114	162 766	(260 705)	368 175
Classe J				
2017	82	-	-	82
2016	82	-	-	82
Classe N				
2017	195 171	27 228	(35 795)	186 604
2016	164 214	25 200	(24 398)	165 016
Actions internationales Hexavest				
Classe A				
2017	96 390	4 389	(23 529)	77 250
2016	118 371	12 081	(20 211)	110 241
Classe B				
2017	73 582	8 391	(18 886)	63 087
2016	82 783	8 985	(11 060)	80 708
Classe D				
2017	222 672	2 436	(33 842)	191 266
2016	267 476	2 940	(27 725)	242 691
Classe E				
2017	69 648	12 553	(11 551)	70 650
2016	89 216	10 589	(7 017)	92 788
Classe F				
2017	32 133	7 685	(6 917)	32 901
2016	26 491	7 711	(5 558)	28 644
Classe G				
2017	68 223	3 807	(9 786)	62 244
2016	60 708	27 424	(17 728)	70 404
Classe H				
2017	99 387	19 850	(14 974)	104 263
2016	88 213	25 699	(12 903)	101 009
Classe I				
2017	36 103	2 556	(2 381)	36 278
2016	24 846	6	(200)	24 652
Classe J				
2017	10 961 861	425 628	(2 296 592)	9 090 897
2016	12 629 146	691 245	(590 757)	12 729 634
Classe N				
2017	259 292	50 996	(51 927)	258 361
2016	222 676	14 985	(11 534)	226 127
Actions internationales C Worldwide				
Classe A				
2017	201 476	24 396	(74 760)	151 112
2016	331 101	71 728	(163 306)	239 523
Classe B				
2017	79 816	6 154	(22 730)	63 240
2016	115 874	19 645	(32 121)	103 398
Classe E				
2017	472 591	119 164	(139 380)	452 375
2016	511 283	184 093	(175 304)	520 072
Classe F				
2017	158 023	41 969	(49 746)	150 246
2016	116 748	74 942	(27 706)	163 984
Classe G				
2017	188 419	83 663	(87 262)	184 820
2016	184 476	62 171	(42 382)	204 265
Classe I				
2017	47 213	45 055	(19 860)	72 408
2016	94 352	54 766	(98 430)	50 688

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions internationales C Worldwide (suite)				
Classe J				
2017	3 683 746	290 681	(271 119)	3 703 308
2016	3 317 961	503 055	(109 039)	3 711 977
Classe K				
2017	2 648 017	38 474	(575 047)	2 111 444
2016	2 948 051	455 647	(813 274)	2 590 424
Classe N				
2017	53 372	2 973	(19 838)	36 507
2016	61 122	3 420	(6 543)	57 999
Indice international BlackRock				
Classe A				
2017	40 768	3 189	(8 566)	35 391
2016	47 887	2 284	(5 909)	44 262
Classe B				
2017	39 833	3 349	(4 906)	38 276
2016	46 796	1 333	(1 970)	46 159
Classe D				
2017	107 880	462	(16 703)	91 639
2016	132 671	2 223	(15 288)	119 606
Classe E				
2017	48 241	39 324	(24 415)	63 150
2016	28 857	34 441	(7 952)	55 346
Classe F				
2017	25 356	19 434	(12 181)	32 609
2016	19 336	14 587	(6 842)	27 081
Classe G				
2017	20 233	3 130	(5 561)	17 802
2016	9 056	21 491	(11 406)	19 141
Classe H				
2017	120 319	16 101	(10 012)	126 408
2016	116 792	20 753	(12 645)	124 900
Classe I				
2017	11 762	97	(173)	11 686
2016	4 266	7 690	(168)	11 788
Classe J				
2017	2 836 833	526 084	(190 305)	3 172 612
2016	2 894 738	649 384	(669 951)	2 874 171
Classe N				
2017	14 755	1 034	(2 087)	13 702
2016	14 187	757	(693)	14 251
Actions mondiales Calamos				
Classe A				
2017	60 658	3 664	(14 327)	49 995
2016	66 631	8 806	(10 534)	64 903
Classe B				
2017	26 963	6 172	(9 598)	23 537
2016	31 061	8 522	(5 783)	33 800
Classe D				
2017	19 742	-	(5 077)	14 665
2016	21 735	155	(1 112)	20 778
Classe E				
2017	146 695	38 033	(51 253)	133 475
2016	58 408	76 725	(13 820)	121 313
Classe F				
2017	139 224	28 712	(16 682)	151 254
2016	69 106	58 406	(10 904)	116 608
Classe G				
2017	212 651	9 576	(91 595)	130 632
2016	94 703	182 128	(10 456)	266 375
Classe H				
2017	28 581	10 337	(4 614)	34 304
2016	28 276	6 060	(2 194)	32 142

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions mondiales Calamos (suite)				
Classe I				
2017	28 961	16 046	(10 987)	34 020
2016	26 131	1 541	(1 730)	25 942
Classe J				
2017	1 904 001	150 293	(565 666)	1 488 628
2016	1 841 492	358 162	(82 271)	2 117 383
Classe N				
2017	26 374	1 132	(13 925)	13 581
2016	32 790	3 174	(10 671)	25 293
Actions mondiales dividendes TD				
Classe A				
2017	149 252	17 903	(82 555)	84 600
2016	157 654	131 690	(99 136)	190 208
Classe B				
2017	57 427	3 842	(15 941)	45 328
2016	63 917	13 818	(14 896)	62 839
Classe E				
2017	634 775	146 196	(210 892)	570 079
2016	487 065	325 058	(151 695)	660 428
Classe F				
2017	380 357	92 044	(78 320)	394 081
2016	269 348	143 445	(47 456)	365 337
Classe G				
2017	236 949	68 440	(65 808)	239 581
2016	186 214	104 096	(32 235)	258 075
Classe I				
2017	8 134	340	(299)	8 175
2016	5 312	6 655	(7 051)	4 916
Classe J				
2017	249 579	463 242	(9 555)	703 266
2016	267 128	8 277	(7 330)	268 075
Classe L				
2017	105 334	49 538	-	154 872
2016	100	21 173	(2 851)	18 422
Classe N				
2017	45 544	5 256	(13 990)	36 810
2016	32 576	17 115	(2 619)	47 072
Actions mondiales Fiera Capital				
Classe A				
2017	17 338	5 183	(2 692)	19 829
2016	-	26 390	(265)	26 125
Classe B				
2017	14 111	3 223	(1 936)	15 398
2016	-	19 848	-	19 848
Classe E				
2017	136 513	101 891	(21 737)	216 667
2016	-	112 348	(320)	112 028
Classe F				
2017	95 544	68 865	(13 333)	151 076
2016	-	62 792	(251)	62 541
Classe G				
2017	85 963	49 617	(17 762)	117 818
2016	-	74 321	(91)	74 230
Classe I				
2017	103	14 512	(4)	14 611
2016	-	103	-	103
Classe J				
2017	1 926 191	158 048	(511 595)	1 572 644
2016	-	1 521 089	(2 488)	1 518 601
Classe N				
2017	25 945	13 888	(13 959)	25 874
2016	-	24 914	(375)	24 539

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

5. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions mondiales couvertes sur les devises Hexavest				
Classe A				
2017	25 137	3 853	(10 386)	18 604
2016	19 352	13 115	(7 691)	24 776
Classe B				
2017	177 856	3 258	(3 550)	177 564
2016	9 286	171 752	(1 369)	179 669
Classe E				
2017	68 932	26 291	(32 930)	62 293
2016	7 483	32 785	(4 858)	35 410
Classe F				
2017	46 877	13 246	(7 758)	52 365
2016	24 418	25 221	(10 570)	39 069
Classe G				
2017	50 055	5 904	(7 612)	48 347
2016	42 620	9 705	(5 079)	47 246
Classe I				
2017	224 185	67 676	(37 226)	254 635
2016	120 605	184 420	(78 625)	226 400
Classe J				
2017	2 080 990	140 207	(354 410)	1 866 787
2016	2 280 862	346 635	(102 453)	2 525 044
Classe N				
2017	79 742	12 851	(25 023)	67 570
2016	28 685	53 066	(4 860)	76 891
Actions mondiales tous pays Hexavest				
Classe A				
2017	500	-	-	500
2016	-	-	-	-
Classe B				
2017	500	-	-	500
2016	-	-	-	-
Classe E				
2017	500	13 114	(836)	12 778
2016	-	-	-	-
Classe F				
2017	2 131	2 548	(500)	4 179
2016	-	-	-	-
Classe G				
2017	25 588	25 741	(25 588)	25 741
2016	-	-	-	-
Classe I				
2017	500	11 750	(42)	12 208
2016	-	-	-	-
Classe J				
2017	3 776 501	528 531	(251 196)	4 053 836
2016	3 193 678	422 897	(239 913)	3 376 622
Classe N				
2017	28 184	4 947	(2 693)	30 438
2016	20 330	5 276	(3 357)	22 249
Actions mondiales à petite capitalisation Lazard				
Classe A				
2017	136 018	9 117	(40 166)	104 969
2016	211 324	37 032	(98 603)	149 753
Classe B				
2017	36 973	3 517	(9 734)	30 756
2016	72 722	10 821	(34 803)	48 740
Classe E				
2017	287 606	37 673	(114 907)	210 372
2016	339 577	84 378	(103 639)	320 316
Classe F				
2017	122 859	48 552	(28 499)	142 912
2016	98 549	54 619	(22 413)	130 755

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

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 Lazard (suite)				
Classe G				
2017	101 789	34 850	(28 587)	108 052
2016	107 089	36 503	(35 279)	108 313
Classe I				
2017	29 603	8 393	(2 281)	35 715
2016	39 769	19 248	(30 248)	28 769
Classe J				
2017	2 248 348	159 307	(130 222)	2 277 433
2016	1 749 712	508 942	(82 217)	2 176 437
Classe N				
2017	43 937	1 060	(16 579)	28 418
2016	42 681	5 410	(3 625)	44 466
Actions marchés émergents Fisher				
Classe A				
2017	53 042	27 254	(19 458)	60 838
2016	226	57 418	(1 190)	56 454
Classe B				
2017	40 078	6 338	(12 976)	33 440
2016	1 113	42 747	(1 888)	41 972
Classe E				
2017	95 885	99 449	(42 565)	152 769
2016	11 033	81 348	(3 112)	89 269
Classe F				
2017	13 263	21 251	(2 472)	32 042
2016	87	8 305	(87)	8 305
Classe G				
2017	13 281	1 436	(978)	13 739
2016	87	13 884	-	13 971
Classe I				
2017	32 499	25 500	(4 861)	53 138
2016	12 004	14 208	(1 624)	24 588
Classe J				
2017	7 038 290	177 570	(452 679)	6 763 181
2016	6 910 502	478 273	(159 601)	7 229 174
Classe K				
2017	-	-	-	-
2016	684 943	80 295	(765 238)	-
Classe N				
2017	46 987	2 680	(11 156)	38 511
2016	34 032	14 147	(3 317)	44 862
Infrastructures mondiales Lazard				
Classe A				
2017	402 099	37 639	(164 167)	275 571
2016	559 908	77 332	(171 560)	465 680
Classe B				
2017	58 791	8 626	(7 135)	60 282
2016	63 646	11 791	(11 582)	63 855
Classe E				
2017	594 230	224 257	(194 226)	624 261
2016	363 032	217 869	(111 251)	469 650
Classe F				
2017	347 065	110 443	(43 244)	414 264
2016	232 901	130 174	(36 006)	327 069
Classe G				
2017	-	-	-	-
2016	218	37	(255)	-
Classe I				
2017	132 663	65 728	(23 779)	174 612
2016	111 676	41 215	(24 750)	128 141
Classe J				
2017	4 343 577	172 453	(853 577)	3 662 453
2016	4 215 282	317 515	(222 756)	4 310 041

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

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 N				
2017	115 736	26 676	(43 587)	98 825
2016	80 635	27 617	(6 654)	101 598
Immobilier mondial Morgan Stanley				
Classe A				
2017	78 726	14 032	(29 852)	62 906
2016	104 461	16 908	(32 835)	88 534
Classe B				
2017	30 791	2 173	(5 439)	27 525
2016	38 102	7 439	(9 745)	35 796
Classe E				
2017	140 509	53 317	(73 288)	120 538
2016	118 279	42 476	(32 939)	127 816
Classe F				
2017	238 463	29 062	(51 569)	215 956
2016	156 436	100 961	(42 167)	215 230
Classe G				
2017	-	-	-	-
2016	75	-	(75)	-
Classe I				
2017	121 236	51 235	(45 042)	127 429
2016	113 243	19 908	(20 877)	112 274
Classe J				
2017	1 818 843	127 532	(647 370)	1 299 005
2016	2 051 142	204 715	(227 012)	2 028 845
Classe K				
2017	899 128	36 041	(118 139)	817 030
2016	1 121 095	120 448	(363 689)	877 854
Classe N				
2017	53 067	2 228	(15 549)	39 746
2016	40 368	17 760	(5 956)	52 172

6. FRAIS DE GESTION ET AUTRES FRAIS

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.

En plus des frais de gestion et d'administration la Société prélève aussi des Fonds des frais de garantie. Ces frais sont établis sur la base de ratios appliqués à la valeur quotidienne de l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs des Fonds et sont inclus dans le ratio des frais de gestion.

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 ».

Certains Fonds peuvent aussi avoir à payer des frais liés à la performance du Fonds. C'est le cas du Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale qui est sujet à des frais à la performance en fonction de son rendement. Ces frais correspondent à 20 % du rendement excédentaire à l'indice de référence. Aux 30 juin 2017 et 2016, il n'y a aucuns frais à la performance à payer pour ce Fonds.

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 à l'exception des frais des Classes I et J qui sont prélevés directement auprès des détenteurs.

La rémunération des principaux dirigeants est déterminée en fonction des tendances du marché. La gestion des Fonds est effectuée par la Société, qui occupe la fonction de principal dirigeant.

Pour la période de six mois terminée le 30 juin 2017, un montant total de 28 479 \$ (2016 – 26 110 \$) a été transféré par l'ensemble des Fonds à la Société à titre de frais de gestion.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

7. TRANSACTIONS ENTRE PARTIES LIÉES (suite)

Lors du lancement d'un Fonds, la Société peut injecter des capitaux dans le Fonds. Le tableau suivant présente au 30 juin 2017 et au 31 décembre 2016, les justes valeurs des capitaux de lancement injecté par la Société:

Fonds	30 juin 2017 (\$)	31 décembre 2016 (\$)
Obligation de sociétés CI Signature	13	51
Actions américaines Beutel Goodman	11	10
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	28	50
Actions mondiales tous pays Hexavest	16	31

8. RISQUES FINANCIERS LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

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 juste valeur des placements représente le risque de crédit maximal à la fin de la période.

De plus, les opérations de prêt 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.

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 monnaie autre que le dollar canadien, fluctuent en raison des variations des cours des monnaies 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.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (non auditées)

Période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars, à l'exception du nombre de part)

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 des 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 auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (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.

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Marché monétaire Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe A	-	-	-	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe A	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe C	-	-	-	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe C	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	-	-	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	-	-	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,00	10,00	10,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,00	10,00	10,00	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	8 072	8 416	12 994	48 005	35 028
Nombre de parts en circulation**	807 203	841 653	1 299 446	4 800 460	3 502 800
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe A	-	-	-	1,63	1,62
Ratio des frais de gestion, Classe A	1,64	1,64	1,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,40	2,40	2,42	-	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe C	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	1,62	1,59	1,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	-	-	1,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	1,62	1,63	1,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	1,62	1,60	1,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	1,65	1,65	1,71	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	-	-	1,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,04	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,04	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	1,64	1,64	1,66	-	-
Trésorerie OGP					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	10,87	10,65
Valeur liquidative par part, Classe A	10,89	10,89	10,93	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,74	10,78	10,91	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	10,89	10,89	10,93	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,89	10,89	10,93	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,90	10,90	10,93	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,87	10,88	10,93	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe I	11,27	11,15	10,96	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,27	11,15	10,96	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	11,27	11,15	10,96	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,89	10,89	10,93	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	62 863	69 302	66 190	59 246	74 708
Nombre de parts en circulation**	5 622 955	6 258 313	6 043 472	5 450 744	7 014 914
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,07	2,07
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,07	2,07	2,07	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,92	2,92	2,91	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,05	2,05	2,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,06	2,05	2,07	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	1,99	1,99	2,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,16	2,17	2,16	-	-
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 N	2,07	2,07	2,06	-	-
Obligations Fiera Capital					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,20	10,52
Valeur liquidative par part, Classe A	11,41	11,22	11,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,24	11,10	11,28	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	11,42	11,22	11,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	11,34	11,17	11,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,42	11,22	11,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,41	11,22	11,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,39	11,21	11,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	11,34	11,17	11,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,84	11,51	11,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,84	11,51	11,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	11,84	11,51	11,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,42	11,22	11,29	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	293 813	333 632	286 915	284 310	322 435
Nombre de parts en circulation**	24 994 111	29 130 467	25 338 791	25 386 243	30 643 460
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,29	2,29
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,32	2,33	2,32	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,20	3,21	3,20	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,27	2,27	2,27	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,68	2,68	2,67	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,26	2,27	2,27	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,29	2,30	2,32	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,40	2,41	2,42	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,68	2,68	2,67	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,04	0,03	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,04	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,03	0,04	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,27	2,27	2,27	-	-
Obligations OGP					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,41	10,63
Valeur liquidative par part, Classe A	11,80	11,62	11,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,63	11,50	11,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	11,81	11,62	11,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,82	11,63	11,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,81	11,62	11,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,79	11,60	11,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	12,26	11,93	11,68	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	12,25	11,92	11,68	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,81	11,62	11,64	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	57 133	59 440	48 451	42 033	40 927
Nombre de parts en circulation**	4 741 304	5 043 535	4 152 212	3 684 019	3 851 435
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,32	2,32
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,35	2,37	2,41	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,24	3,25	3,30	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,31	2,32	2,36	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,29	2,28	2,36	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,34	2,35	2,41	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,44	2,45	2,52	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,07	0,08	0,13	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,07	0,08	0,13	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,31	2,32	2,36	-	-
Obligations PIMCO					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	10,41	9,85
Valeur liquidative par part, Classe A	10,72	10,61	10,62	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,57	10,50	10,61	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	10,73	10,62	10,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,73	10,62	10,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,73	10,61	10,62	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,71	10,60	10,62	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,16	10,91	10,66	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,16	10,91	10,66	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,73	10,61	10,63	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	112 402	121 751	111 288	100 180	122 487
Nombre de parts en circulation**	10 227 610	11 295 565	10 454 632	9 620 571	12 432 874
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,46	2,46
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,51	2,51	2,50	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,39	3,39	3,38	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,46	2,46	2,45	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,46	2,45	2,45	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,49	2,49	2,50	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,59	2,60	2,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,11	0,11	0,10	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,11	0,11	0,10	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,47	2,46	2,45	-	-
Obligations mondiales PIMCO					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	10,34	-
Valeur liquidative par part, Classe A	10,97	10,67	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,81	10,56	10,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	10,99	10,68	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,99	10,68	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,98	10,67	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,94	10,65	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,50	11,02	10,39	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,50	11,02	10,39	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,99	10,68	10,34	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	29 953	22 335	17 373	10 827	-
Nombre de parts en circulation**	2 678 087	2 063 488	1 676 793	1 047 537	-
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,76	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,86	2,85	2,86	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,75	3,76	3,76	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,76	2,76	2,76	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,74	2,74	2,75	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,80	2,81	2,85	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,00	2,99	3,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	0,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	0,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,76	2,76	2,76	-	-
Obligations de sociétés CI Signature					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,44	10,12	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,38	10,11	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,45	10,12	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,44	10,12	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,43	10,11	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,62	10,15	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,62	10,15	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,45	10,12	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	15 684	2 286	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 501 139	225 930	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,80	2,80	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,70	3,70	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,70	2,70	-	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,80	2,80	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,95	2,95	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,70	2,71	-	-	-
Indice obligataire BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,38	10,70
Valeur liquidative par part, Classe A	11,59	11,45	11,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,42	11,34	11,51	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	11,60	11,46	11,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,60	11,46	11,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,59	11,45	11,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,57	11,44	11,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	12,04	11,76	11,57	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	12,03	11,76	11,56	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,61	11,46	11,52	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	50 495	51 022	52 311	44 036	47 581
Nombre de parts en circulation**	4 206 059	4 348 145	4 526 075	3 868 281	4 446 715
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,25	2,25
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,30	2,30	2,29	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,18	3,18	3,17	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,25	2,25	2,24	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,23	2,24	2,24	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,27	2,27	2,29	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,38	2,38	2,39	-	-
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	2,22	2,20	2,24	-	-
Stratégie sécuritaire					
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe A	-	-	-	11,84	11,16
Valeur liquidative par part, Classe A	12,51	12,29	12,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,32	12,16	11,98	-	-
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe C	-	-	-	10,31	-
Valeur liquidative par part, Classe C	12,55	12,32	12,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	12,56	12,32	12,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	12,53	12,31	12,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,49	12,27	11,99	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	13,12	12,71	12,05	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,16	12,74	12,08	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	11,69	11,32	10,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	12,56	12,32	12,00	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	101 663	105 792	96 876	91 646	100 144
Nombre de parts en circulation**	8 145 243	8 631 954	8 103 384	7 768 994	8 973 197

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe A	-	-	-	2,72	2,73
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,94	2,94	2,95	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,86	3,86	3,87	-	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe C	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,74	2,74	2,75	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,73	2,74	2,75	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,86	2,85	2,90	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,07	3,08	3,10	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,05	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,05	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,04	0,05	0,05	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,74	2,74	2,75	-	-
Stratégie équilibrée					
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe A	-	-	-	11,84	11,04
Valeur liquidative par part, Classe A	12,80	12,60	12,12	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,64	12,49	12,11	-	-
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe C	-	-	-	10,43	-
Valeur liquidative par part, Classe C	12,87	12,65	12,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	12,87	12,65	12,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	12,81	12,61	12,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,74	12,56	12,12	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	13,47	13,06	12,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,47	13,06	12,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	12,14	11,77	10,98	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	12,87	12,65	12,13	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	226 051	242 731	242 982	233 033	261 328
Nombre de parts en circulation**	17 608 140	19 244 413	20 087 002	19 741 007	23 664 979
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe A	-	-	-	2,78	2,79
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,15	3,15	3,15	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,92	3,92	3,92	-	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe C	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,80	2,80	2,80	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,79	2,80	2,80	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,09	3,09	3,10	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,44	3,45	3,45	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,05	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,05	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,04	0,05	0,05	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,80	2,80	2,80	-	-
Stratégie croissance					
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe A	-	-	-	13,25	12,30
Valeur liquidative par part, Classe A	14,61	14,33	13,60	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	14,47	14,22	13,59	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe C	-	-	-	10,51	-
Valeur liquidative par part, Classe C	14,73	14,41	13,61	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	14,73	14,41	13,61	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	14,64	14,34	13,60	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	14,52	14,26	13,59	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	15,43	14,88	13,67	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	15,51	14,95	13,74	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	12,54	12,10	11,11	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	14,73	14,41	13,61	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	57 416	63 106	60 342	61 833	69 600
Nombre de parts en circulation**	4 001 262	4 452 424	4 473 973	4 701 377	5 659 049
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe A	-	-	-	2,84	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,35	3,36	3,36	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,97	3,98	3,98	-	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe C	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,85	2,86	2,86	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,85	2,86	2,86	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,25	3,26	3,26	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,75	3,76	3,76	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,04	0,05	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,85	2,86	2,86	-	-
Stratégie audacieuse					
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe A	-	-	-	12,15	11,17
Valeur liquidative par part, Classe A	13,67	13,40	12,80	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,50	13,28	12,79	-	-
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe C	-	-	-	10,65	-
Valeur liquidative par part, Classe C	13,78	13,48	12,81	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,79	13,48	12,81	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,67	13,40	12,80	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,55	13,32	12,79	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,47	13,94	12,87	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,55	14,01	12,94	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	13,00	12,52	11,56	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,79	13,48	12,81	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	30 996	30 178	29 310	27 948	21 352
Nombre de parts en circulation**	2 278 347	2 270 673	2 321 861	2 337 335	1 911 530
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe A	-	-	-	2,96	2,97
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,47	3,47	3,47	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,22	4,23	4,22	-	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe C	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,96	2,97	2,97	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,96	2,96	2,97	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,42	3,47	3,47	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,00	4,00	4,02	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,04	0,05	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,97	2,97	2,97	-	-
Celestia sécuritaire					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,68	10,98
Valeur liquidative par part, Classe A	12,42	12,19	11,91	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,24	12,06	11,89	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	12,47	12,22	11,91	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	12,47	12,22	11,91	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	12,43	12,19	11,91	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,38	12,16	11,91	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	13,05	12,62	11,96	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,11	12,67	12,01	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	12,47	12,22	11,91	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	93 972	94 525	85 411	63 663	48 869
Nombre de parts en circulation**	7 538 481	7 738 660	7 169 670	5 452 082	4 452 348
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,84	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,10	3,11	3,10	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,98	3,99	3,97	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,85	2,86	2,85	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,85	2,86	2,85	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,04	3,05	3,05	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,29	3,30	3,30	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,07	0,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,07	0,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,86	2,87	2,85	-	-
Celestia équilibré					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,83	11,02
Valeur liquidative par part, Classe A	12,81	12,54	12,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,67	12,44	12,12	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	12,90	12,60	12,14	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	12,91	12,60	12,14	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	12,84	12,56	12,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,75	12,50	12,12	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	13,53	13,02	12,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,60	13,10	12,26	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	12,90	12,60	12,14	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	145 508	156 259	143 134	114 726	91 959
Nombre de parts en circulation**	11 313 633	12 429 505	11 797 685	9 701 236	8 343 236

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,95	2,96
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,43	3,43	3,42	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,10	4,10	4,09	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,98	2,98	2,97	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,97	2,97	2,97	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,30	3,30	3,32	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,70	3,70	3,72	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,10	0,11	0,09	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,10	0,11	0,09	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,98	2,99	2,97	-	-
Celestia croissance					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,23	11,35
Valeur liquidative par part, Classe A	13,42	13,12	12,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,28	13,03	12,62	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	13,53	13,20	12,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,54	13,20	12,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,44	13,13	12,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,33	13,06	12,62	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,20	13,65	12,70	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,29	13,74	12,78	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,53	13,20	12,64	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	56 310	62 642	57 740	48 364	41 625
Nombre de parts en circulation**	4 174 759	4 754 210	4 568 217	3 954 476	3 667 113
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,01	3,01
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,54	3,55	3,52	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,16	4,17	4,14	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,04	3,05	3,02	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,02	3,02	3,02	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,46	3,46	3,47	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,94	3,94	3,97	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,12	0,13	0,11	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,12	0,13	0,11	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,04	3,05	3,02	-	-
Celestia audacieux					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,13	11,21
Valeur liquidative par part, Classe A	13,50	13,18	12,59	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,33	13,06	12,58	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	13,61	13,25	12,60	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	13,33	13,06	12,58	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,62	13,26	12,60	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,48	13,17	12,59	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,32	13,06	12,58	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	13,16	12,95	12,57	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe I	14,28	13,71	12,66	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,40	13,82	12,76	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,61	13,25	12,60	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	37 728	38 004	40 400	39 544	32 283
Nombre de parts en circulation**	2 789 263	2 879 776	3 207 393	3 261 110	2 878 631
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,06	3,07
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,58	3,59	3,57	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,35	4,36	4,32	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,10	3,10	3,07	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	4,35	4,35	4,32	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,06	3,05	3,07	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,66	3,65	3,67	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,38	4,38	4,37	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	5,10	5,10	5,07	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,13	0,14	0,13	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,13	0,14	0,13	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,10	3,10	3,07	-	-
Portefeuille fondamental sécuritaire BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,05	11,38
Valeur liquidative par part, Classe A	12,75	12,56	12,06	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,57	12,43	12,04	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	12,81	12,60	12,06	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	12,80	12,59	12,06	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	12,76	12,57	12,06	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,71	12,53	12,05	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	13,38	13,01	12,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,38	13,00	12,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	12,80	12,59	12,06	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	17 457	17 799	17 182	18 133	17 157
Nombre de parts en circulation**	1 366 800	1 415 704	1 424 755	1 504 240	1 507 718
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,68	2,68
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,96	2,96	2,96	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,82	3,82	3,83	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,66	2,67	2,71	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,70	2,71	2,71	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,90	2,89	2,91	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,16	3,16	3,16	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,23	0,24	0,26	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,23	0,24	0,26	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,72	2,72	2,71	-	-
Portefeuille fondamental équilibré BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,45	11,76
Valeur liquidative par part, Classe A	13,59	13,35	12,37	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe B	13,44	13,25	12,36	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	13,69	13,42	12,38	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,70	13,42	12,38	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,64	13,38	12,37	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,53	13,31	12,37	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,24	13,79	12,42	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,32	13,87	12,50	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,69	13,42	12,38	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 090	44 792	45 915	48 306	47 158
Nombre de parts en circulation**	3 013 304	3 345 438	3 709 853	3 880 436	4 009 317
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,76	2,75
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,22	3,23	3,26	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,89	3,89	3,93	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,77	2,77	2,81	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,75	2,76	2,81	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,00	3,01	3,16	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,49	3,50	3,56	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,39	0,40	0,44	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,39	0,40	0,44	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,78	2,79	2,80	-	-
Portefeuille fondamental croissance BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,61	11,91
Valeur liquidative par part, Classe A	13,93	13,70	12,53	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,79	13,60	12,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	14,05	13,77	12,54	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	14,06	13,78	12,54	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,97	13,72	12,53	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,84	13,63	12,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,58	14,15	12,58	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,70	14,25	12,67	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	14,04	13,77	12,54	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 476	23 383	22 924	25 298	26 063
Nombre de parts en circulation**	1 462 423	1 700 862	1 828 772	2 006 918	2 188 869
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,80	2,79
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,30	3,31	3,34	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,94	3,95	3,96	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,81	2,82	2,84	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,75	2,75	2,84	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,11	3,12	3,29	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,69	3,70	3,79	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,46	0,47	0,51	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,46	0,47	0,51	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,83	2,84	2,84	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Portefeuille fondamental audacieux BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,83	12,11
Valeur liquidative par part, Classe A	14,39	14,10	12,76	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	14,21	13,98	12,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	14,52	14,18	12,77	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	14,51	14,18	12,77	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	14,37	14,08	12,76	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	14,20	13,97	12,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	15,20	14,68	12,92	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	15,20	14,68	12,92	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	14,51	14,18	12,77	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	14 496	17 049	16 382	18 323	19 816
Nombre de parts en circulation**	1 004 124	1 206 363	1 283 405	1 427 909	1 635 660
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,86	2,84
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,37	3,38	3,42	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,14	4,15	4,17	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,85	2,85	2,92	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,85	2,88	2,92	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,48	3,48	3,52	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,19	4,19	4,22	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,53	0,53	0,58	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,53	0,53	0,58	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,90	2,87	2,92	-	-
Équilibré Power Dynamique					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,85	11,14
Valeur liquidative par part, Classe A	11,69	11,81	12,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,50	11,68	11,98	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	11,78	11,88	12,01	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,79	11,88	12,01	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,67	11,80	11,99	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,51	11,68	11,98	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	12,44	12,33	12,07	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	12,54	12,43	12,17	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,78	11,88	12,01	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	7 524	11 560	14 864	11 783	9 990
Nombre de parts en circulation**	642 433	976 620	1 238 687	994 761	896 849
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,33	3,32
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,82	3,83	3,95	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,80	4,78	4,93	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,32	3,33	3,45	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,27	3,28	3,45	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,89	3,89	4,20	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,76	4,77	4,90	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,06	0,19	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,06	0,19	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,32	3,33	3,45	-	-
Revenu mensuel sécuritaire Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,78	9,76	9,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	9,59	9,63	9,72	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	9,83	9,79	9,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	9,83	9,80	9,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	9,79	9,77	9,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	9,74	9,73	9,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,31	10,13	9,78	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,00	10,61	9,89	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	11,19	10,80	10,06	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	9,83	9,80	9,73	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	16 850	12 906	3 732	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 710 116	1 316 244	383 519	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,25	3,30	3,25	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,45	4,45	4,39	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,95	2,95	2,93	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,94	2,93	2,91	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,22	3,24	3,20	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,49	3,54	3,51	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,19	0,19	0,15	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,19	0,19	0,15	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,19	0,19	0,15	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,94	2,95	2,91	-	-
Revenu mensuel Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	9,91	9,86	9,68	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	9,73	9,74	9,67	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	9,99	9,92	9,69	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,00	9,92	9,69	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	9,93	9,88	9,69	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	9,85	9,82	9,68	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,49	10,25	9,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,20	10,77	9,85	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	11,42	10,98	10,05	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,08	10,01	9,77	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 845	16 794	4 645	-	-
Nombre de parts en circulation**	2 786 000	1 692 160	479 334	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,54	3,55	3,49	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,60	4,65	4,59	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,05	3,05	3,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,01	2,99	2,99	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,40	3,42	3,39	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,91	3,95	3,88	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,23	0,23	0,17	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,23	0,23	0,17	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,23	0,23	0,17	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,05	3,00	2,81	-	-
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge					
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe A	-	-	-	7,74	-
Valeur liquidative par part, Classe A	7,70	7,81	7,70	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	7,62	7,76	7,70	-	-
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe C	-	-	-	10,57	-
Valeur liquidative par part, Classe C	7,76	7,86	7,71	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	7,77	7,86	7,71	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	7,69	7,80	7,70	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	7,59	7,73	7,69	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	8,14	8,12	7,74	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	8,71	8,53	7,82	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	12,51	12,25	11,24	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	7,76	7,86	7,71	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	142 298	149 725	131 357	115 210	-
Nombre de parts en circulation**	18 042 013	18 861 845	17 023 157	14 891 143	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe A	-	-	-	2,91	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,48	3,48	3,44	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,10	4,10	4,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe C	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,98	2,98	2,94	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,93	2,92	2,94	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,56	3,55	3,64	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,32	4,32	4,34	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,17	0,17	0,14	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,17	0,17	0,14	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,17	0,17	0,14	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,99	2,99	2,94	-	-
Revenu et croissance mondial CI Signature					
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe A	-	-	-	6,33	-
Valeur liquidative par part, Classe A	6,35	6,35	6,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	6,27	6,29	6,62	-	-
Valeur liquidative par part, Ancienne Classe C	-	-	-	10,84	-
Valeur liquidative par part, Classe C	6,41	6,38	6,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	6,41	6,39	6,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	6,34	6,34	6,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	6,26	6,28	6,62	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	6,77	6,63	6,67	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe J	7,35	7,04	6,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	13,35	12,79	12,27	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	6,41	6,38	6,63	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	116 042	111 880	92 071	52 088	-
Nombre de parts en circulation**	17 322 028	16 865 121	13 689 234	8 230 000	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe A	-	-	-	3,22	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,70	3,70	3,69	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,43	4,42	4,41	-	-
Ratio des frais de gestion, Ancienne Classe C	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,21	3,21	3,19	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,16	3,14	3,19	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,84	3,82	3,94	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,60	4,58	4,64	-	-
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	3,79	-	-
Actions canadiennes dividendes Guardian					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,95	12,58
Valeur liquidative par part, Classe A	13,55	13,68	11,58	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,35	13,54	11,57	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,67	13,77	11,59	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,49	13,64	11,58	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,33	13,53	11,56	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,27	14,19	11,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,27	14,19	11,64	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	11,87	11,80	9,68	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,66	13,76	11,59	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	84 449	75 397	48 990	56 146	42 228
Nombre de parts en circulation**	6 272 854	5 535 480	4 230 510	4 334 641	3 356 207
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,74	2,74
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,36	3,39	3,27	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,26	4,29	4,27	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,85	2,86	2,87	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,62	3,64	3,67	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,28	4,37	4,42	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,22	0,25	0,23	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,22	0,25	0,23	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,22	0,25	0,23	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,86	2,89	2,87	-	-
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	22,34	20,36
Valeur liquidative par part, Classe A	23,92	24,33	21,17	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe B	23,50	24,03	21,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	23,50	24,03	21,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	24,13	24,48	21,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	23,82	24,26	21,16	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	23,52	24,05	21,13	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	23,15	23,78	21,10	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	25,26	25,28	21,27	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	25,26	25,28	21,27	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	24,12	24,47	21,18	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	177 346	178 400	166 795	169 829	181 097
Nombre de parts en circulation**	7 233 369	7 203 458	7 861 366	7 602 700	8 893 313
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,82	2,82
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,31	3,32	3,32	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,40	4,40	4,40	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	4,40	4,40	4,40	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,80	2,80	2,82	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,59	3,58	3,62	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,34	4,34	4,37	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	5,32	5,32	5,32	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	0,01	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	0,01	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,81	2,81	2,82	-	-
Actions canadiennes Triasima					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	14,87	13,79
Valeur liquidative par part, Classe A	15,53	15,58	14,82	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	15,28	15,41	14,80	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	15,26	15,39	14,79	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	15,66	15,67	14,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	15,48	15,54	14,81	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	15,27	15,40	14,79	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	15,03	15,23	14,77	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	16,40	16,19	14,89	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	16,40	16,19	14,89	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	16,40	16,19	14,89	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	15,66	15,67	14,83	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	264 539	269 486	224 734	198 502	194 800
Nombre de parts en circulation**	16 269 919	16 755 732	15 105 758	13 349 054	14 130 140
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,81	2,81
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,31	3,31	3,31	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,29	4,29	4,29	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	4,39	4,38	4,39	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,81	2,81	2,81	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,53	3,51	3,61	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,32	4,32	4,41	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	5,31	5,30	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 N	2,81	2,81	2,81	-	-
Actions canadiennes Montrusco Bolton					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	10,59	10,49
Valeur liquidative par part, Classe A	10,82	11,11	9,47	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,55	10,92	9,44	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,91	11,18	9,47	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,77	11,08	9,46	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,63	10,97	9,45	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,47	11,57	9,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,47	11,57	9,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	11,47	11,57	9,52	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,91	11,18	9,47	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	62 064	60 220	77 178	29 384	23 893
Nombre de parts en circulation**	5 424 670	5 210 493	8 110 306	2 775 460	2 278 674
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,13	3,14
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,61	3,57	3,58	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,14	5,09	5,11	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,11	3,05	3,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,89	3,84	3,88	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,71	4,66	4,68	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,07	0,02	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,07	0,02	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,07	0,02	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,11	3,06	3,08	-	-
Indice canadien BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,87	11,96
Valeur liquidative par part, Classe A	13,31	13,43	11,47	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,07	13,26	11,45	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	13,15	13,32	11,46	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,43	13,51	11,48	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,25	13,39	11,47	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,08	13,27	11,45	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	12,88	13,13	11,44	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,05	13,95	11,53	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,12	14,02	11,59	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,42	13,51	11,48	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	20 867	15 819	10 121	14 213	17 308
Nombre de parts en circulation**	1 548 711	1 180 129	883 072	1 104 498	1 446 931

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,76	2,77
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,27	3,27	3,26	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,38	4,38	4,38	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	4,04	4,04	4,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,75	2,74	2,76	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,54	3,54	3,56	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,35	4,35	4,36	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	5,27	5,27	5,26	-	-
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	2,77	2,77	2,76	-	-
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	17,17	15,87
Valeur liquidative par part, Classe A	17,30	18,70	16,94	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	16,90	18,40	16,90	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	17,46	18,82	16,95	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	17,21	18,63	16,93	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	16,99	18,47	16,91	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	18,34	19,48	17,03	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	18,34	19,48	17,03	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	17,45	18,81	16,95	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	36 572	39 162	35 818	35 301	40 651
Nombre de parts en circulation**	2 065 561	2 060 995	2 110 493	2 055 532	2 562 250
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,09	3,08
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,60	3,60	3,59	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,05	5,05	5,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,07	3,06	3,09	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,93	3,92	3,99	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,76	4,70	4,79	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,06	0,06	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,06	0,06	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,10	3,10	3,09	-	-
Actions américaines Hillsdale					
Valeur liquidative par part, Classe A	23,82	22,65	21,05	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	23,39	22,37	21,02	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	24,02	22,78	21,07	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	23,71	22,58	21,05	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	23,43	22,39	21,02	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	25,27	23,60	21,16	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	24,96	23,31	20,90	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	28,62	26,73	23,97	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	23,72	22,49	20,80	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	60 013	58 307	67 273	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Nombre de parts en circulation**	2 246 533	2 318 308	2 972 929	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,66	3,69	3,64	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,78	4,81	4,79	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,16	3,19	3,16	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,93	3,99	3,97	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,71	4,70	4,72	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,06	0,08	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,06	0,08	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,06	0,08	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,16	3,19	3,17	-	-
Actions américaines Beutel Goodman					
Valeur liquidative par part, Classe A	12,21	11,51	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,99	11,36	10,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	12,31	11,58	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	12,15	11,47	10,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,00	11,37	10,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	12,93	11,98	10,39	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	12,93	11,98	10,39	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	12,31	11,58	10,34	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 788	24 194	620	-	-
Nombre de parts en circulation**	3 421 470	2 104 298	59 988	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,60	3,60	3,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,72	4,72	4,72	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,09	3,09	3,09	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,87	3,90	3,90	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,64	4,65	4,65	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,11	0,11	0,11	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,11	0,11	0,11	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,09	3,10	3,09	-	-
Actions américaines Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,39	10,57	10,27	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,19	10,44	10,25	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	11,23	10,47	10,26	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,49	10,63	10,28	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,34	10,54	10,27	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,20	10,45	10,26	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	11,02	10,33	10,24	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	12,05	10,99	10,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	12,05	10,99	10,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,48	10,63	10,28	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 513	45 540	1 117	-	-
Nombre de parts en circulation**	3 659 977	4 314 777	108 778	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,49	3,53	3,59	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,58	4,61	4,70	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	4,32	4,35	4,47	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,99	3,03	3,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,75	3,79	3,88	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,53	4,54	4,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	5,50	5,53	5,58	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,07	0,10	0,09	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,07	0,10	0,09	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,99	3,03	3,08	-	-
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,08	10,02	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,00	10,01	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,11	10,02	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,06	10,02	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,01	10,01	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,32	10,06	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,32	10,06	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,11	10,02	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	3 657	712	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	328 658	71 043	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,58	3,62	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,70	4,73	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,08	3,12	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,88	3,92	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,63	4,67	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,10	0,13	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,10	0,13	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,08	3,11	-	-	-
Indice américain BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	10,49	8,74
Valeur liquidative par part, Classe A	13,37	12,86	12,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,12	12,69	12,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	13,19	12,73	12,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,48	12,93	12,35	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,32	12,82	12,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,15	12,71	12,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	12,93	12,56	12,31	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,13	13,36	12,41	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,29	13,52	12,55	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,48	12,93	12,35	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	42 319	42 035	38 160	27 890	25 299
Nombre de parts en circulation**	3 158 290	3 265 362	3 090 808	2 659 703	2 894 472
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	2,87	2,88

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,38	3,38	3,36	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,50	4,50	4,48	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	4,20	4,20	4,18	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,84	2,85	2,86	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,54	3,63	3,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,37	4,38	4,41	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	5,38	5,38	5,36	-	-
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	2,86	-	-
Actions internationales Hexavest					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	8,48	8,38
Valeur liquidative par part, Classe A	9,95	9,42	9,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	9,75	9,29	9,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	9,80	9,32	9,74	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,04	9,48	9,76	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	9,91	9,39	9,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	9,77	9,30	9,74	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	9,62	9,20	9,72	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,64	9,87	9,81	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	10,64	9,87	9,81	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,04	9,48	9,76	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	105 624	117 195	133 477	111 157	131 995
Nombre de parts en circulation**	9 987 197	11 919 291	13 609 926	13 101 261	15 747 203
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,60	3,61
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,14	4,17	4,11	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,38	5,41	5,35	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	5,06	5,09	5,02	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,61	3,64	3,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,43	4,44	4,46	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	5,25	5,28	5,25	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	6,19	6,21	6,15	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,08	0,11	0,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,08	0,11	0,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,63	3,66	3,60	-	-
Actions internationales C WorldWide					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,53	10,97
Valeur liquidative par part, Classe A	14,18	12,58	13,71	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	13,89	12,40	13,68	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	14,30	12,66	13,72	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	14,11	12,54	13,70	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,92	12,42	13,68	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	15,11	13,16	13,79	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe J	15,11	13,16	13,79	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	15,11	13,16	13,79	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	14,29	12,65	13,72	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	103 685	98 424	105 788	82 161	73 453
Nombre de parts en circulation**	6 925 460	7 532 673	7 680 968	7 127 782	6 693 438
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,39	3,39
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,88	3,88	3,88	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,12	5,12	5,12	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,35	3,36	3,38	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,18	4,15	4,23	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,98	4,97	5,03	-	-
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 N	3,39	3,39	3,38	-	-
Indice international BlackRock					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,07	11,00
Valeur liquidative par part, Classe A	13,02	12,02	12,76	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,76	11,85	12,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	12,83	11,89	12,74	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,13	12,09	12,77	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	12,96	11,97	12,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,78	11,86	12,74	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	12,59	11,74	12,72	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	13,83	12,53	12,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,83	12,53	12,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,13	12,09	12,77	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	49 418	40 663	42 483	37 484	33 296
Nombre de parts en circulation**	3 603 275	3 265 980	3 314 586	3 387 349	3 027 785
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,19	3,20
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,68	3,67	3,68	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,91	4,91	4,92	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	4,60	4,60	4,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,17	3,15	3,18	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,98	3,99	4,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,83	4,83	4,83	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	5,72	5,72	5,73	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	0,02	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	0,02	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,17	3,17	3,18	-	-
Actions mondiales Calamos					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	12,08	11,04
Valeur liquidative par part, Classe A	13,89	13,32	14,03	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe B	13,61	13,14	14,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe D	13,52	13,08	13,99	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	14,00	13,40	14,04	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,86	13,30	14,02	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	13,65	13,16	14,00	-	-
Valeur liquidative par part, Classe H	13,44	13,02	13,98	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,85	13,96	14,11	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	14,85	13,96	14,11	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	14,01	13,40	14,04	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	30 217	35 746	31 998	25 661	23 571
Nombre de parts en circulation**	2 074 091	2 593 850	2 270 333	2 123 907	2 134 234
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,56	3,56
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,06	4,06	4,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,28	5,28	5,30	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe D	5,66	5,66	5,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,56	3,55	3,56	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,20	4,15	4,36	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	5,10	5,09	5,15	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe H	6,06	6,06	6,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,53	3,54	3,56	-	-
Actions mondiales dividendes TD					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,28	-
Valeur liquidative par part, Classe A	13,12	12,61	12,56	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,80	12,40	12,53	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,23	12,69	12,57	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	13,07	12,59	12,55	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,89	12,46	12,54	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	13,95	13,17	12,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,95	13,17	12,63	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	11,38	10,74	10,30	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,22	12,68	12,57	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	29 644	23 492	18 471	7 571	-
Nombre de parts en circulation**	2 236 792	1 867 351	1 469 314	671 440	-
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,36	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,79	3,79	3,77	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,24	5,24	5,27	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,28	3,28	3,27	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,00	3,97	4,07	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,85	4,84	4,87	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,03	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,03	0,03	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,03	0,03	0,03	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,31	3,31	3,27	-	-
Actions mondiales Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,73	10,53	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,56	10,45	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,80	10,56	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,71	10,52	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,60	10,47	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	12,24	10,77	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	12,29	10,81	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,79	10,56	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	25 906	24 773	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	2 133 917	2 301 708	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,11	4,11	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,47	5,46	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,57	3,56	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,28	4,28	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	5,14	5,14	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,06	0,06	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,06	0,06	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,58	3,57	-	-	-
Actions mondiales couvertes sur les devises Hexavest					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	13,88	12,95
Valeur liquidative par part, Classe A	15,47	15,08	13,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	15,15	14,86	13,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	15,60	15,17	13,76	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	15,40	15,03	13,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	15,20	14,89	13,73	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	16,53	15,80	13,84	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	16,53	15,80	13,84	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	15,59	15,16	13,76	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	41 618	43 143	35 044	29 489	26 601
Nombre de parts en circulation**	2 548 165	2 753 774	2 533 311	2 123 904	2 054 037
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,64	3,63
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,14	4,10	4,13	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,39	5,36	5,37	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,64	3,60	3,63	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,35	4,36	4,43	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	5,21	5,18	5,23	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,09	0,06	0,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,09	0,06	0,08	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,65	3,62	3,63	-	-
Actions mondiales tous pays Hexavest					

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe A	10,54	10,27	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,44	10,25	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,57	10,27	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,52	10,26	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,47	10,25	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,78	10,31	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	19,07	18,24	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	18,02	17,51	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	78 458	69 700	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	4 140 180	3 834 404	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,69	3,72	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,19	5,21	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,20	3,22	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,00	4,02	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	4,80	4,83	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,06	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,06	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,20	3,61	-	-	-
Actions mondiales à petite capitalisation Lazard					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	18,43	16,13
Valeur liquidative par part, Classe A	21,35	20,85	21,79	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	20,92	20,56	21,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	21,54	20,98	21,81	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	21,23	20,77	21,78	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	20,94	20,57	21,75	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	22,76	21,80	21,92	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	22,76	21,80	21,92	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	21,52	20,97	21,81	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	65 967	64 866	58 217	43 155	40 164
Nombre de parts en circulation**	2 938 627	3 007 133	2 661 423	2 341 885	2 489 972
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,49	3,49
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,96	4,05	4,07	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,20	5,30	5,31	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,41	3,52	3,57	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,30	4,39	4,47	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	5,14	5,23	5,27	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,07	0,17	0,18	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,07	0,17	0,18	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,46	3,56	3,57	-	-
Actions marchés émergents Fisher					
Valeur liquidative par part, Classe A	13,11	11,23	11,43	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	12,71	10,99	11,40	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	13,23	11,30	11,44	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non auditées)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe F	13,03	11,17	11,43	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	12,86	11,08	11,42	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	14,09	11,81	11,51	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	13,90	11,65	11,36	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	-	-	11,36	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,04	11,14	11,29	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	99 106	85 318	86 939	-	-
Nombre de parts en circulation**	7 147 658	7 333 325	7 654 028	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,41	4,41	4,29	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	6,29	6,31	6,29	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,79	3,87	3,90	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,57	4,86	4,85	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	5,57	5,66	5,59	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	0,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	0,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	-	-	0,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,91	3,91	3,91	-	-
Infrastructures mondiales Lazard					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	11,42	9,86
Valeur liquidative par part, Classe A	14,93	12,98	12,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	14,71	12,85	12,28	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	15,06	13,06	12,30	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	14,84	12,93	12,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	-	-	12,37	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	15,93	13,59	12,37	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	15,93	13,58	12,37	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	15,05	13,05	12,30	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	83 144	80 517	69 504	69 592	51 974
Nombre de parts en circulation**	5 310 268	5 994 161	5 627 296	6 093 916	5 271 021
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,52	3,54
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,98	4,00	4,00	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,85	4,86	4,98	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,46	3,46	3,49	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,36	4,34	4,50	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	-	-	3,49	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,06	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,06	0,06	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,50	3,50	3,50	-	-
Immobilier mondial Morgan Stanley					
Valeur liquidative par part*	-	-	-	14,07	11,60
Valeur liquidative par part, Classe A	15,24	15,31	16,11	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	14,88	15,05	16,07	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	15,37	15,40	16,12	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour la période terminée le 30 juin 2017 (en milliers de dollars)

	2017	2016	2015	2014	2013
	30 juin	31 décembre	31 décembre	31 décembre	31 décembre
Fonds SSQ	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)	(IFRS)
Valeur liquidative par part, Classe F	15,14	15,23	16,10	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	-	-	16,44	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	16,06	15,88	16,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	16,06	15,88	16,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe K	16,06	15,88	16,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	15,37	15,40	16,12	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	43 128	53 374	60 526	58 295	61 708
Nombre de parts en circulation**	2 710 135	3 380 763	3 743 201	4 142 729	5 318 546
Ratio des frais de gestion*	-	-	-	3,69	3,69
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,30	4,27	4,12	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	5,70	5,72	5,57	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,77	3,74	3,62	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	4,69	4,68	4,62	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	-	-	3,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	1,08	1,08	0,93	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	1,08	1,08	0,93	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	1,08	1,08	0,93	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,80	3,77	3,62	-	-

*Valeur liquidative par part ou ratio de frais de gestion avant le 9 novembre 2015

**Nombre de parts total du Fonds



Les valeurs à la bonne place

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

