



Investissement

États financiers audités au 31 décembre 2021

Fonds SSQ



Table des matières

	Page
Fonds SSQ Marché monétaire Fiera Capital	3
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital	8
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital	13
Fonds SSQ Obligations PIMCO	18
Fonds SSQ Obligations et prêts bancaires AlphaFixe	23
Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO	28
Fonds SSQ Obligations de sociétés CI Signature	33
Fonds SSQ Indice obligataire BlackRock	38
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire	43
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré	48
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - croissance	53
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux	58
Fonds SSQ Stratégie sécuritaire	64
Fonds SSQ Stratégie équilibrée	69
Fonds SSQ Stratégie croissance	74
Fonds SSQ Stratégie audacieuse	79
Fonds SSQ Stratégie 100% actions	84
Fonds SSQ Celestia sécuritaire	89
Fonds SSQ Celestia équilibré	94
Fonds SSQ Celestia croissance	99
Fonds SSQ Celestia audacieux	104
Fonds SSQ Célestia 100% actions	109
Fonds SSQ Revenu sécuritaire Guardian	115
Fonds SSQ Revenu Guardian	120
Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge	125
Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI Signature	130
Fonds SSQ Actions canadiennes dividendes Guardian	135
Fonds SSQ Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée	140
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima	145
Fonds SSQ Indice canadien BlackRock	151
Fonds SSQ Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital	156
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale	161
Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman	168
Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital	173
Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	178
Fonds SSQ Indice américain BlackRock	183
Fonds SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher	188
Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners	193
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide	198
Fonds SSQ Indice international BlackRock	204
Fonds SSQ Actions mondiales dividendes TD	209
Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital	214
Fonds SSQ Actions mondiales GQG Partners	219
Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Fisher	224
Fonds SSQ Actions marchés émergents Fisher	229
Fonds SSQ Infrastructures mondiales Lazard	234
Fonds SSQ Immobilier mondial CI	239
Notes complémentaires aux états financiers	244
Rapport de l'auditeur indépendant	280
Annexe – informations financières	283

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	14 156	20 491
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	17	21
Total de l'actif	14 173	20 512
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	196	72
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	5	1
Total du passif	201	73
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	13 972	20 439
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 (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
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	181	141
Distributions par le fonds sous-jacent	40	141
	221	282
Charges		
Frais de gestion (note 7)	186	208
Frais d'administration	12	14
Frais de transactions	-	-
	198	222
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	23	60
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe C	-	0,01
Classe I	0,01	0,06
Classe J	0,01	0,08

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	20 439	12 881
Opérations sur les parts		
Parts émises	46 850	47 501
Parts rachetées	(53 317)	(39 943)
	(6 467)	7 558
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(23)	(60)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	23	60
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	13 972	20 439

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	23	60
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	(40)	(141)
	(17)	(81)
Transactions de placements		
Acquisitions	(37 675)	(36 420)
Cessions	44 050	28 915
	6 375	(7 505)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	8	(20)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	6 366	(7 606)
Financement		
Distributions effectuées pour le compte des souscripteurs	(23)	(60)
Parts émises	46 850	47 501
Parts rachetées	(53 317)	(39 943)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(6 490)	7 498
Variation nette de la trésorerie	(124)	(108)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(72)	36
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(196)	(72)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (101,32 %)			
Fonds Fiera de gestion active d'encaisse	1 415 615	<u>14 156</u>	<u>14 156</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-1,32 %)			<u>(184)</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>13 972</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera de gestion active d'encaisse</i>	%
Province du Manitoba, 0,18 %, 19-01-2022	4,24
Municipal Finance Authority of British Columbia, 0,30 %, 12-01-2022	3,67
Nestlé SA, 0,30 %, 13-01-2022	3,39
Province de la Colombie-Britannique, 0,14 %, 27-01-2022	3,39
Omers Financier, 0,39 %, 01-02-2022	3,39
Fédération des Caisses Desjardins du Québec, 0,23 %, 03-03-2022	3,39
Province de la Saskatchewan, 0,23 %, 08-03-2022	3,11
Province de la Saskatchewan, 0,20 %, 22-02-2022	3,08
Province de la Saskatchewan, 0,17 %, 18-01-2022	2,97
Province de Québec, 0,09 %, 21-01-2022	2,82
Province de la Nouvelle-Écosse, 0,19 %, 20-01-2022	2,82
Province de l'Alberta, 0,16 %, 01-02-2022	2,82
Banque de Nouvelle-Écosse, 0,27 %, 11-04-2022	2,82
Province du Nouveau-Brunswick, 0,19 %, 17-02-2022	2,54
Omers Financier, 0,30 %, 13-01-2022	2,46
Banque Nationale du Canada, 0,21 %, 23-02-2022	2,41
Banque Royale du Canada, 0,19 %, 07-02-2022	2,40
Banque Nationale du Canada, 0,24 %, 13-01-2022	2,26
CIBC, 0,17 %, 31-01-2022	2,14
Omers Financier, 0,28 %, 10-01-2022	2,12
Province de la Colombie-Britannique, 0,13 %, 26-01-2022	2,12
Province de l'Ontario, 0,16 %, 02-02-2022	1,98
Nestlé SA, 0,39 %, 01-02-2022	1,98
Province de Québec, 0,27 %, 01-04-2022	1,98
CIBC, 0,11 %, 17-01-2022	1,98

FONDS SSQ MARCHÉ MONÉTAIRE FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	20 491	-	-	20 491
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	20 491	-	-	20 491

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	58 600	72 195
Trésorerie	754	269
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	348
Total de l'actif	59 354	72 812
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	505	-
Autres créditeurs	5	12
Total du passif	510	12
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	58 844	72 800
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,15	11,44
Classe B	10,85	11,14
Classe C	11,18	11,46
Classe E	11,16	11,45
Classe F	11,18	11,47
Classe G	11,11	11,41
Classe I	12,66	12,73
Classe J	12,66	12,73
Classe K	12,66	12,73
Classe N	11,15	11,44

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	983	239
Non réalisé(e) sur les placements	(2 873)	1 920
Total gain net (perte nette)	(1 890)	2 159
Intérêts aux fins d'attribution	701	1 739
Prêts de titres	5	5
Distributions par le fonds sous-jacent	792	-
	(392)	3 903
Charges		
Frais de gestion (note 7)	311	281
Frais d'administration	16	15
Frais de transactions	-	-
	327	296
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(719)	3 607
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,30)	0,41
Classe B	(0,29)	0,40
Classe C	(0,29)	0,42
Classe E	(0,29)	0,41
Classe F	(0,29)	0,41
Classe G	(0,29)	0,41
Classe I	(0,07)	0,71
Classe J	(0,07)	0,71
Classe K	(0,07)	0,71
Classe N	(0,30)	0,41

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	72 800	65 198
Opérations sur les parts		
Parts émises	48 944	39 297
Parts rachetées	(62 181)	(35 302)
	(13 237)	3 995
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(719)	3 607
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	58 844	72 800

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(719)	3 607
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	1 890	(2 159)
Distributions par le fonds sous-jacent	(792)	-
	379	1 448
Transactions de placements		
Acquisitions	(144 173)	(138 980)
Cessions	157 175	133 643
	13 002	(5 337)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	341	(4)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	13 722	(3 893)
Financement		
Parts émises	48 944	39 297
Parts rachetées	(62 181)	(35 302)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(13 237)	3 995
Variation nette de la trésorerie	485	102
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	269	167
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	754	269
Intérêts reçus	1 054	1 738
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,59 %)			
Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations à court terme	5 956 048	59 488	58 600
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,41 %)			244
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			58 844

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations à court terme</i>	%
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	12,28
Province de l'Ontario, 2,60 %, 08-09-2023	3,97
Banque Royale du Canada, 2,33 %, 28-01-2027	2,70
Province de l'Ontario, 2,40 %, 02-06-2026	2,59
Municipalité St Sylvestre PQ, 1,30 %, 09-07-2026	1,59
L'Ange Gardien PQ, 1,25 %, 10-09-2026	1,58
St-Hyacinthe PQ, 1,25 %, 30-08-2026	1,46
Banque Toronto-Dominion, 3,11 %, 22-04-2030	1,38
Banque de Montréal, 2,08 %, 17-06-2030	1,35
Banque de Montréal, 2,70 %, 11-09-2024	1,31
Thetford Mines PQ, 1,65 %, 28-05-2026	1,31
Société Financière Manuvie, 2,24 %, 12-05-2030	1,27
BMW Canada Inc., 2,41 %, 27-11-2023	1,24
Province de l'Ontario, 2,85 %, 02-06-2023	1,16
Financière Sun Life Inc., 2,46 %, 18-11-2031	1,07
Choice Properties REIT, 2,46 %, 30-11-2026	1,07
Terrebonne PQ, 1,35 %, 23-07-2026	1,07
Riocan Real Estate Investment Trust, 2,58 %, 12-02-2025	1,06
Banque de Concentra, 1,46 %, 17-05-2024	1,05
Toyota Credit Canada, 2,31 %, 23-10-2024	1,04
First Capital Real Estate Investment Trust, 4,32 %, 31-07-2025	1,02
Matane PQ, 1,00 %, 22-10-2025	1,02
Beloeil PQ, 1,00 %, 08-12-2025	1,01
St-Benoit-Labre PQ, 1,30 %, 16-07-2026	1,01
Central 1 Credit Union, 2,58 %, 06-12-2023	0,99

FONDS SSQ OBLIGATIONS COURT TERME FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera ASFI- Gestion active obligations à court terme (Au 31 décembre 2020, le Fonds était principalement investi dans des titres à revenu fixe canadiens émis par le gouvernement fédéral, les gouvernements provinciaux, les municipalités ainsi que des sociétés canadiennes). Au 31 décembre 2021, le Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez-vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement vise d'abord la préservation du capital et favorise une approche de gestion basée sur l'anticipation des taux d'intérêt, la gestion de la courbe d'échéance, le choix des secteurs et le choix des titres. La gestion des écarts de crédit et la synchronisation des interventions sont également considérées.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	72 160	-	72 160
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	35	-	35
Total	-	72 195	-	72 195

Au 31 décembre 2021, le Fonds détient des instruments financiers de niveau 1 suite à un changement de la politique d'investissement. Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	297 706	350 449
Trésorerie	342	3 195
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	298 048	353 644
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	3 020
Autres créditeurs	74	108
Total du passif	74	3 128
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	297 974	350 516
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,02	12,66
Classe B	11,69	12,31
Classe C	12,05	12,68
Classe D	11,89	12,52
Classe E	12,05	12,69
Classe F	12,04	12,68
Classe G	12,00	12,63
Classe H	11,89	12,52
Classe I	13,82	14,23
Classe J	13,82	14,23
Classe K	13,82	14,23
Classe N	12,04	12,68

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(1 027)	2 548
Non réalisé(e) sur les placements	(19 162)	16 700
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	871	4 333
Total gain net (perte nette)	(19 318)	23 581
Intérêts aux fins d'attribution	1	4
Distributions par le fonds sous-jacent	8 850	9 202
	(10 467)	32 787
Charges		
Frais de gestion (note 7)	1 247	1 317
Frais d'administration	58	62
Frais de transactions	-	-
	1 305	1 379
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(11 772)	31 408
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,65)	0,91
Classe B	(0,63)	0,89
Classe C	(0,65)	0,91
Classe D	(0,64)	0,90
Classe E	(0,65)	0,92
Classe F	(0,65)	0,92
Classe G	(0,65)	0,91
Classe H	(0,64)	0,90
Classe I	(0,44)	1,32
Classe J	(0,43)	1,32
Classe K	(0,43)	1,33
Classe N	(0,65)	0,91

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	350 516	333 883
Opérations sur les parts		
Parts émises	76 948	97 260
Parts rachetées	(117 718)	(112 035)
	(40 770)	(14 775)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(11 772)	31 408
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	297 974	350 516

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(11 772)	31 408
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	20 189	(19 248)
Distributions par le fonds sous-jacent	(9 721)	(13 535)
	(1 304)	(1 375)
Transactions de placements		
Acquisitions	(32 650)	(46 357)
Cessions	71 905	64 995
	39 255	18 638
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(34)	7
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	37 917	17 270
Financement		
Parts émises	76 948	97 260
Parts rachetées	(117 718)	(112 035)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(40 770)	(14 775)
Variation nette de la trésorerie	(2 853)	2 495
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	3 195	700
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	342	3 195
Intérêts reçus	1	4
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,91 %)				
Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations canadiennes univers	66,93	18 368 312	202 173	199 448
Fonds Fiera Obligations - Gestion tactique	32,98	9 295 031	100 619	98 258
TOTAL DES PLACEMENTS (99,91 %)			302 792	297 706
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,09 %)				268
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				297 974

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera ASFI - Gestion active obligations canadiennes univers</i>	%
Fiera Capital Gestion active - municipale à court terme	14,46
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-06-2031	7,78
Gouvernement du Canada, 0,250 %, 01-03-2026	4,79
Province de l'Ontario, 4,65 %, 02-06-2041	4,28
Gouvernement du Canada, 5,750 %, 01-06-2033	4,27

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera Obligations - Gestion tactique</i>	%
Fiera Capital Gestion active - municipale à court terme	15,50
Gouvernement du Canada, 0,50 %, 01-12-2030	11,50
Royal Office Finance LP, 5,21 %, 12-11-2032	6,09
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-06-2031	5,58
Toronto Community Housing Corp., 4,88 %, 11-05-2037	5,38

FONDS SSQ OBLIGATIONS FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans les fonds sous-jacents Fiera ASFI – Gestion active obligations canadiennes univers 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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par Corporation Fiera Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion complémentaire. L'actif du fonds est composé d'environ 67 % du fonds Fiera ASFI – Gestion active obligations canadiennes univers (approche de gestion basée sur la durée, la courbe d'échéance et le crédit) et 33 % du Fonds Fiera 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	350 449	-	-	350 449
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	350 449	-	-	350 449

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	103 411	121 185
Trésorerie	-	1 609
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	103 411	122 794
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	129	-
Achat de placements à payer	-	1 435
Autres créditeurs	63	73
Total du passif	192	1 508
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	103 219	121 286
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,52	12,04
Classe B	11,21	11,71
Classe C	11,55	12,06
Classe E	11,55	12,06
Classe F	11,54	12,05
Classe G	11,50	12,01
Classe I	13,34	13,61
Classe J	13,34	13,61
Classe L	11,91	12,15
Classe N	11,54	12,06

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(768)	252
Non réalisé(e) sur les placements	(7 148)	4 209
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1 284	3 084
Total gain net (perte nette)	(6 632)	7 545
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	3 714	4 145
	(2 918)	11 691
Charges		
Frais de gestion (note 7)	862	858
Frais d'administration	39	38
Frais de transactions	-	-
	901	896
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 819)	10 795
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,55)	0,94
Classe B	(0,54)	0,91
Classe C	(0,56)	0,94
Classe E	(0,55)	0,94
Classe F	(0,55)	0,95
Classe G	(0,55)	0,94
Classe I	(0,33)	1,36
Classe J	(0,33)	1,36
Classe L	(0,29)	1,22
Classe N	(0,55)	0,94

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	121 286	104 953
Opérations sur les parts		
Parts émises	45 947	43 671
Parts rachetées	(60 195)	(38 133)
	(14 248)	5 538
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 819)	10 795
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	103 219	121 286

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(3 819)	10 795
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	7 916	(4 461)
Distributions par le fonds sous-jacent	(4 998)	(7 229)
	(901)	(895)
Transactions de placements		
Acquisitions	(21 570)	(22 120)
Cessions	34 991	18 910
	13 421	(3 210)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(10)	3
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	12 510	(4 102)
Financement		
Parts émises	45 947	43 671
Parts rachetées	(60 195)	(38 133)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(14 248)	5 538
Variation nette de la trésorerie	(1 738)	1 436
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	1 609	173
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(129)	1 609
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (100,19 %)			
PIMCO Canada Canadian CorePLUS Bond Trust	1 022 557	106 745	103 411
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,19 %)			(192)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			103 219

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>PIMCO Canada Canadian CorePLUS Bond Trust</i>	%
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-12-2051	4,12
Ginnie Mae II TBA, 2,50 %, 22-02-2052	3,12
Fannie Mae TBA, 2,50 %, 14-02-2052	2,84
Province de l'Ontario, 3,45 %, 02-06-2045	2,44
Contrat à terme obligation américaine 10 ans, 6,00 %, 23-03-2022	2,39
Gouvernement du Canada, 3,50 %, 01-12-2045	2,29
Contrat à terme Gouvernement du Canada 5 ans, 6,00 %, 23-03-2022	2,00
Province de l'Alberta, 2,90 %, 01-12-2028	1,86
Province de l'Alberta, 2,05 %, 01-06-2030	1,82
Province de l'Ontario, 1,55 %, 01-11-2029	1,77
Province de l'Ontario, 5,85 %, 08-03-2033	1,75
Province de l'Alberta, 2,90 %, 20-09-2029	1,61
Province de l'Alberta, 1,65 %, 01-06-2031	1,47
Province de l'Ontario, 3,50 %, 02-06-2043	1,24
Province de l'Ontario, 2,70 %, 02-06-2029	1,09
Contrat à terme obligation américaine 5 ans, 6,00 %, 01-04-2022	0,92
Gouvernement du Canada, 1,75 %, 01-12-2053	0,91
Province de l'Ontario, 2,90 %, 02-06-2028	0,90
Gouvernement du Canada, 2,75 %, 01-12-2048	0,81
Province de Québec, 4,25 %, 01-12-2043	0,78
Province de l'Ontario, 6,20 %, 02-06-2031	0,73
Goldman Sachs Group Inc., 3,31 %, 31-10-2025	0,70
Province de l'Ontario, 2,80 %, 02-06-2048	0,65
Province de l'Ontario, 4,70 %, 02-06-2037	0,63
Lloyds Banking Group PLC, 3,50 %, 03-02-2025	0,57

FONDS SSQ OBLIGATIONS PIMCO

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	121 185	-	-	121 185
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	121 185	-	-	121 185

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	104 828	84 981
Trésorerie	739	1 412
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	105 567	86 393
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	1 310
Autres créditeurs	34	33
Total du passif	34	1 343
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	105 533	85 050
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,52	10,77
Classe B	10,47	10,72
Classe E	10,53	10,78
Classe F	10,53	10,78
Classe G	10,52	10,77
Classe I	11,49	11,47
Classe J	11,49	11,47
Classe N	10,53	10,78

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(126)	(133)
Non réalisé(e) sur les placements	(2 461)	1 667
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	195	1 059
Total gain net (perte nette)	(2 392)	2 593
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 749	1 888
	357	4 482
Charges		
Frais de gestion (note 7)	341	221
Frais d'administration	14	9
Frais de transactions	-	-
	355	230
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2	4 252
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,23)	0,40
Classe B	(0,22)	0,40
Classe E	(0,22)	0,40
Classe F	(0,22)	0,40
Classe G	(0,22)	0,40
Classe I	0,04	0,70
Classe J	0,04	0,70
Classe N	(0,23)	0,40

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	85 050	57 396
Opérations sur les parts		
Parts émises	48 977	42 014
Parts rachetées	(28 496)	(18 612)
	20 481	23 402
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2	4 252
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	105 533	85 050

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2	4 252
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	2 587	(1 534)
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 944)	(2 947)
	(355)	(229)
Transactions de placements		
Acquisitions	(35 615)	(29 415)
Cessions	14 815	7 085
	(20 800)	(22 330)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1	16
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(21 154)	(22 543)
Financement		
Parts émises	48 977	42 014
Parts rachetées	(28 496)	(18 612)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	20 481	23 402
Variation nette de la trésorerie	(673)	859
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	1 412	553
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	739	1 412
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,33 %)			
Fonds AlphaFixe RendementPlus	10 447 231	<u>105 388</u>	<u>104 828</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,67 %)			<u>705</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>105 533</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds AlphaFixe RendementPlus</i>	%
Alphafixe prêts bancaires à taux variable, Série F	34,30
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	2,80
Province de l'Ontario, 3,50 %, 02-06-2024	2,24
Gouvernement du Canada, Rendement Réel, 2,00 %, 01-12-2041	2,01
Banque Royale du Canada, 3,30 %, 26-09-2023	1,35
Province de l'Ontario, 2,80 %, 02-06-2048	1,34
Province de l'Ontario, 2,40 %, 02-06-2026	1,18
Province de Québec, 2,75 %, 01-09-2025	1,15
Réseau de transport de la Capitale, 1,00%, 18-11-2025	1,11
Gouvernement du Canada, 1,00 %, 01-09-2026	1,03
Province de l'Ontario, 2,90 %, 02-06-2028	0,93
Province de l'Ontario, 4,65 %, 02-06-2041	0,87
Province de l'Ontario, 1,55 %, 01-11-2029	0,84
Province de l'Ontario, 2,70 %, 02-06-2029	0,81
Banque Nationale du Canada, 2,55 %, 12-07-2024	0,75
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-12-2051	0,72
Province de Québec, 3,10 %, 01-12-2051	0,70
Province de l'Ontario, 1,85 %, 01-02-2027	0,69
Province de l'Ontario, 2,65 %, 02-12-2050	0,65
Banque de Montréal, 1,55 %, 28-05-2026	0,63
Fairfax Financial Holdings Ltd, 3,95 %, 03-03-2031	0,63
Province de l'Ontario, 3,50 %, 02-06-2043	0,60
Province de l'Alberta, 3,30 %, 01-12-2046	0,59
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 1,95 %, 15-12-2025	0,58
Ville de Gatineau, 1,00 %, 03-12-2025	0,57

FONDS SSQ OBLIGATIONS ET PRÊTS BANCAIRES ALPHAFIXE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations et prêts bancaires AlphaFixe est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent AlphaFixe RendementPlus. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations et prêts bancaires AlphaFixe se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par AlphaFixe Capital selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion combinant l'analyse structurelle et cyclique afin de déterminer les projections économiques et la direction des marchés financiers.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	84 981	-	-	84 981
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	84 981	-	-	84 981

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	55 669	67 657
Trésorerie	-	751
Cession de placements à recevoir	2 575	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	58 244	68 408
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	28	-
Achat de placements à payer	-	740
Autres créditeurs	2 400	45
Total du passif	2 428	785
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	55 816	67 623
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,34	11,60
Classe B	11,02	11,28
Classe C	11,37	11,64
Classe E	11,38	11,64
Classe F	11,36	11,62
Classe G	11,30	11,56
Classe I	13,47	13,41
Classe J	13,47	13,41
Classe L	11,49	11,43
Classe N	11,37	11,63

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	241	(342)
Non réalisé(e) sur les placements	(2 199)	1 830
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1 102	-
Total gain net (perte nette)	(856)	1 488
Distributions par le fonds sous-jacent	1 128	2 068
	272	3 556
Charges		
Frais de gestion (note 7)	476	434
Frais d'administration	18	16
Frais de transactions	-	-
	494	450
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(222)	3 106
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,27)	0,30
Classe B	(0,26)	0,29
Classe C	(0,27)	0,30
Classe E	(0,27)	0,30
Classe F	(0,27)	0,31
Classe G	(0,26)	0,31
Classe I	0,05	0,69
Classe J	0,05	0,69
Classe L	0,05	0,60
Classe N	(0,27)	0,30

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	67 623	69 726
Opérations sur les parts		
Parts émises	23 437	19 187
Parts rachetées	(35 022)	(24 396)
	(11 585)	(5 209)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(222)	3 106
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	55 816	67 623

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(222)	3 106
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	1 958	(1 488)
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 230)	(2 068)
	(494)	(450)
Transactions de placements		
Acquisitions	(9 352)	(7 062)
Cessions	18 297	13 412
	8 945	6 350
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2 355	(3)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	10 806	5 897
Financement		
Parts émises	23 437	19 187
Parts rachetées	(35 022)	(24 396)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(11 585)	(5 209)
Variation nette de la trésorerie	(779)	688
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	751	63
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(28)	751
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,74 %)				
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	33,09	1 326 290	18 815	18 467
Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada), Série I	66,65	3 540 323	37 225	37 202
TOTAL DES PLACEMENTS (99,74 %)			56 040	55 669
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,26 %)				147
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				55 816

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Fannie Mae TBA, 3,50 %, 01-03-2052	7,99
Fannie Mae TBA, 4,00 %, 01-02-2052	2,91
Citigroup Mortgage Loan Trust, 0,00 %, 01-11-2061	2,29
Fannie Mae TBA, 4,00 %, 01-01-2052	1,95
Jamestown Residential DAC, 0,29 %, 24-06-2059	1,87

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Gouvernement du Japon, Bon du trésor, 0,00 %, 11-01-2022	4,14
Gouvernement du Japon, Bon du trésor, 0,00 %, 28-03-2022	3,95
Gouvernement du Japon, Bon du trésor, 0,00 %, 22-03-2022	2,97
Gouvernement du Japon, 0,10 %, 20-09-2031	2,37
Gouvernement de Chine, 2,85 %, 04-06-2027	2,18

FONDS SSQ OBLIGATIONS MONDIALES PIMCO

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO est un fonds distinct qui investit exclusivement dans les fonds sous-jacents Revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I et Obligations mondiales flexible PIMCO (Canada), Série I. Par conséquent, le Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par PIMCO Canada selon une méthode de gestion qui lui est propre. L'actif du fonds est composé d'environ 33 % du Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada) (approche de gestion tactique des meilleures idées de revenus à l'échelle mondiale) et 67 % du Fonds d'obligations mondiales flexible PIMCO (Canada) (approche de gestion active en obligations mondiales qui met l'emphase 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	67 657	-	-	67 657
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	67 657	-	-	67 657

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, 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 (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	36 624	26 517
Trésorerie	850	96
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	37 474	26 613
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	790	-
Autres créditeurs	19	8
Total du passif	809	8
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	36 665	26 605
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,75	11,52
Classe B	11,53	11,31
Classe E	11,78	11,55
Classe F	11,77	11,54
Classe G	11,72	11,49
Classe I	13,52	12,91
Classe J	13,52	12,91
Classe N	11,77	11,55

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	67	(149)
Non réalisé(e) sur les placements	(521)	336
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	461	340
Total gain net (perte nette)	7	527
Distributions par le fonds sous-jacent	1 320	1 297
	1 327	1 824
Charges		
Frais de gestion (note 7)	536	511
Frais d'administration	21	20
Frais de transactions	-	-
	557	531
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	770	1 293
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,23	0,49
Classe B	0,23	0,48
Classe E	0,24	0,50
Classe F	0,24	0,50
Classe G	0,24	0,49
Classe I	0,62	0,87
Classe J	0,62	0,87
Classe N	0,23	0,49

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	26 605	24 610
Opérations sur les parts		
Parts émises	20 401	9 775
Parts rachetées	(11 111)	(9 073)
	9 290	702
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	770	1 293
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	36 665	26 605

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	770	1 293
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	454	(187)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 781)	(1 637)
	(557)	(531)
Transactions de placements		
Acquisitions	(12 635)	(4 325)
Cessions	4 645	4 175
	(7 990)	(150)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	11	2
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(8 536)	(679)
Financement		
Parts émises	20 401	9 775
Parts rachetées	(11 111)	(9 073)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	9 290	702
Variation nette de la trésorerie	754	23
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	96	73
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	850	96
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,89 %)			
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I	3 431 901	36 777	36 624
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,11 %)			41
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			36 665

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I</i>	%
Dresdner Funding Trust I, 8,15 %, 30-06-2031	1,22
Fairfax India Holdings, 5,00 % 26-02-2028	0,96
Inter Pipeline Ltd, 6,63 %, 19-11-2079	0,69
Inter Pipeline Ltd, 6,88 %, 26-03-2079	0,66
Barclay's Bank PLC, 6,28 %, 15-12-2034	0,64
Pembina Pipeline Corp., 4,80 %, 25-01-2081	0,62
Citigroup Capital XIII, 6,58 %, 30-10-2040	0,61
Credit Suisse Group AG, 6,25 %, 31-12-2049	0,56
Hughes Satellite Systems Corp., 5,25 %, 01-08-2026	0,55
Cineplex Inc. 7,50 % 26-02-2026	0,53
General Electric Co., 3,53% Perp	0,52
Lincoln National Corp., 2,52 %, 17-05-2066	0,52
Enbridge Inc., 4,10 %, 21-09-2051	0,48
Keyera Corp., 6,88 %, 13-06-2079	0,47
MGM Growth Properties Operating Partnership LP, 4,50 %, 15-01-2028	0,47
Quotient Ltd, 4,75 %, 26-05-2026	0,46
Suncor Energy Inc., 5,00 %, 09-04-2030	0,46
Canada Goose Inc., Term Loan, 07-10-2027	0,46
First Capital Realty Inc., 3,60 %, 06-05-2026	0,45
Reliance LP, 3,84 %, 15-03-2025	0,45
Sysco Canada, Inc., 3,65 %, 25-04-2025	0,45
Ing Groep NV, 6,50 %, 16-04-2025	0,45
Quotient Ltd, 12,00 %, 15-10-2023	0,45
Delta Air Lines Inc., Term Loan 20-10-2027	0,44
General Motors Financial Co. Inc., 5,70 %, 30-09-2030	0,44

FONDS SSQ OBLIGATIONS DE SOCIÉTÉS CI SIGNATURE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 CI, 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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement vise à sélectionner un choix de titres dont le gestionnaire estime que la valeur fondamentale n'est pas reflétée dans la cote de crédit et le rendement courant.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	26 517	-	-	26 517
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	26 517	-	-	26 517

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	65 998	26 099
Trésorerie	2 296	-
Cession de placements à recevoir	300	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	68 594	26 099
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	5
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	2 760	12
Total du passif	2 760	17
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	65 834	26 082
Valeur liquidative, par part		
Classe A	12,05	12,64
Classe B	11,72	12,30
Classe C	12,07	12,66
Classe E	12,08	12,67
Classe F	12,08	12,67
Classe G	12,02	12,61
Classe I	13,85	14,21
Classe J	13,85	14,21
Classe N	12,09	12,69

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(230)	609
Non réalisé(e) sur les placements	(1 344)	872
Total gain net (perte nette)	(1 574)	1 481
Distributions par le fonds sous-jacent	648	851
	(926)	2 332
Charges		
Frais de gestion (note 7)	112	113
Frais d'administration	5	5
Frais de transactions	-	-
	117	118
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 043)	2 214
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(0,51)	0,69
Classe B	(0,50)	0,67
Classe C	(0,51)	0,69
Classe E	(0,51)	0,69
Classe F	(0,51)	0,70
Classe G	(0,51)	0,69
Classe I	(0,27)	1,08
Classe J	(0,27)	1,07
Classe N	(0,51)	0,69

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	26 082	35 299
Opérations sur les parts		
Parts émises	64 234	14 209
Parts rachetées	(23 439)	(25 640)
	40 795	(11 431)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 043)	2 214
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	65 834	26 082

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(1 043)	2 214
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	1 574	(1 481)
Distributions par le fonds sous-jacent	(648)	(851)
	(117)	(118)
Transactions de placements		
Acquisitions	(61 635)	(11 380)
Cessions	20 510	22 980
	(41 125)	11 600
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2 748	(3)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(38 494)	11 479
Financement		
Parts émises	64 234	14 209
Parts rachetées	(23 439)	(25 640)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	40 795	(11 431)
Variation nette de la trésorerie	2 301	48
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(5)	(53)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	2 296	(5)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,25 %)			
Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D	2 107 722	65 874	65 998
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,25 %)			(164)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			65 834

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds BlackRock Canada indiciel obligations univers, Classe D</i>	%
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-06-2031	1,63
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-12-2051	1,46
Gouvernement du Canada, 1,25 %, 01-06-2030	1,20
Gouvernement du Canada, 0,05 %, 01-09-2025	1,17
Gouvernement du Canada, 0,05 %, 01-12-2030	1,12
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 2,90 %, 15-06-2024	0,89
Gouvernement du Canada, 1,75 %, 01-12-2053	0,86
Gouvernement du Canada, 2,00 %, 01-09-2023	0,86
Province de Québec, 3,50 %, 01-12-2048	0,83
Province de l'Ontario, 2,90 %, 02-06-2049	0,79
Gouvernement du Canada, 2,75 %, 01-12-2048	0,76
Province de l'Ontario, 2,90 %, 02-12-2046	0,76
Gouvernement du Canada, 1,00 %, 01-09-2026	0,76
Gouvernement du Canada, 0,25 %, 01-02-2023	0,76
Gouvernement du Canada, 0,25 %, 01-04-2024	0,75
Gouvernement du Canada, 1,50 %, 01-12-2031	0,74
Province de l'Ontario, 3,45 %, 02-06-2045	0,74
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	0,73
Gouvernement du Canada, 5,75 %, 01-06-2029	0,73
Province de l'Ontario, 2,65 %, 02-12-2050	0,72
Province de Québec, 3,10 %, 01-12-2051	0,70
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 1,95 %, 15-12-2025	0,69
Gouvernement du Canada, 0,25 %, 01-05-2023	0,69
Fiducie canadienne pour l'habitation No 1, 2,35 %, 15-09-2023	0,67
Gouvernement du Canada, 1,75 %, 01-03-2023	0,66

FONDS SSQ INDICE OBLIGATAIRE BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	26 099	-	-	26 099
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	26 099	-	-	26 099

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	21 691	25 169
Trésorerie	-	193
Cession de placements à recevoir	290	-
Autres débiteurs	-	75
Total de l'actif	21 981	25 437
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	238	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	21	20
Total du passif	259	20
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	21 722	25 417
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,97	10,40
Classe B	10,98	10,40
Classe C	10,99	10,41
Classe E	10,98	10,40
Classe F	11,00	10,41
Classe G	10,99	10,40
Classe I	11,72	10,82
Classe J	11,72	10,82
Classe N	10,98	10,40

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	398	(233)
Non réalisé(e) sur les placements	353	574
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	555	165
Total gain net (perte nette)	1 306	506
Distributions par le fonds sous-jacent	506	608
	1 812	1 114
Charges		
Frais de gestion (note 7)	527	549
Frais d'administration	22	22
Frais de transactions	-	-
	549	571
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 263	543
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,56	0,21
Classe B	0,57	0,21
Classe C	0,57	0,22
Classe E	0,56	0,21
Classe F	0,57	0,22
Classe G	0,57	0,22
Classe I	0,88	0,49
Classe J	0,88	0,49
Classe N	0,56	0,21

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	25 417	22 153
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 996	17 906
Parts rachetées	(8 954)	(15 185)
	(4 958)	2 721
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 263	543
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	21 722	25 417

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 263	543
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(751)	(341)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 061)	(773)
	(549)	(571)
Transactions de placements		
Acquisitions	(996)	(12 352)
Cessions	5 996	10 171
	5 000	(2 181)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	76	(75)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	4 527	(2 827)
Financement		
Parts émises	3 996	17 906
Parts rachetées	(8 954)	(15 185)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(4 958)	2 721
Variation nette de la trésorerie	(431)	(106)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	193	299
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(238)	193
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (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 AlphaFixe RendementPlus	52,18	1 129 623	11 506	11 335
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z	8,01	114	1 681	1 739
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	15,89	131 850	2 858	3 451
Fonds américain à faible volatilité TD	13,88	142 207	2 704	3 016
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	9,90	106 958	2 143	2 150
TOTAL DES PLACEMENTS (99,86 %)			20 892	21 691
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,14 %)				31
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				21 722

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - SÉCURITAIRE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

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

Obligations (60 %)

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

Actions canadiennes (16 %)

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

Actions étrangères (24 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse		-	-	
Fonds de placement	25 169	-	-	25 169
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	25 169	-	-	25 169

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	31 740	39 260
Trésorerie	121	-
Cession de placements à recevoir	-	85
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	31 861	39 345
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	130
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	34	39
Total du passif	34	169
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	31 827	39 176
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,08	10,13
Classe B	11,08	10,13
Classe C	11,09	10,13
Classe E	11,09	10,13
Classe F	11,12	10,15
Classe G	11,09	10,13
Classe I	11,85	10,55
Classe J	11,85	10,55
Classe N	11,08	10,13

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	91	59
Non réalisé(e) sur les placements	1 753	(299)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1 202	139
Total gain net (perte nette)	3 046	(101)
Distributions par le fonds sous-jacent	687	1 096
	3 733	995
Charges		
Frais de gestion (note 7)	794	943
Frais d'administration	32	37
Frais de transactions	-	-
	826	980
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 907	15
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,93	-
Classe B	0,94	-
Classe C	0,94	-
Classe E	0,94	-
Classe F	0,95	0,01
Classe G	0,94	-
Classe I	1,28	0,26
Classe J	1,28	0,26
Classe N	0,93	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	39 176	39 523
Opérations sur les parts		
Parts émises	4 634	18 913
Parts rachetées	(14 890)	(19 275)
	(10 256)	(362)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 907	15
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	31 827	39 176

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 907	15
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 844)	240
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 889)	(1 235)
	(826)	(980)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 968)	(13 178)
Cessions	14 306	14 364
	11 338	1 186
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(5)	2
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	10 507	208
Financement		
Parts émises	4 634	18 913
Parts rachetées	(14 890)	(19 275)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(10 256)	(362)
Variation nette de la trésorerie	251	(154)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(130)	24
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	121	(130)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,73 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	27,94	886 167	9 047	8 892
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z	3,46	71	1 018	1 100
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z	8,35	175	2 583	2 658
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	21,06	256 039	5 683	6 702
Fonds américain à faible volatilité TD	18,04	270 786	5 212	5 743
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	20,88	330 508	6 673	6 645
TOTAL DES PLACEMENTS (99,73 %)			30 216	31 740
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,27 %)				87
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				31 827

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - ÉQUILIBRÉ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

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

Obligations (40 %)

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

Actions canadiennes (21 %)

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

Actions étrangères (39 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse		-	-	
Fonds de placement	39 260	-	-	39 260
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	39 260	-	-	39 260

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	11 204	13 783
Trésorerie	90	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	11 294	13 783
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	89
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	21	25
Total du passif	21	114
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	11 273	13 669
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,05	9,93
Classe B	11,04	9,93
Classe C	11,04	9,93
Classe E	11,05	9,94
Classe F	11,08	9,95
Classe G	11,06	9,94
Classe I	11,83	10,35
Classe J	11,82	10,35
Classe N	11,04	9,93

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(203)	(106)
Non réalisé(e) sur les placements	992	(432)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	485	30
Total gain net (perte nette)	1 274	(508)
Distributions par le fonds sous-jacent	243	451
	1 517	(57)
Charges		
Frais de gestion (note 7)	296	397
Frais d'administration	11	16
Frais de transactions	-	-
	307	413
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 210	(470)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,07	(0,29)
Classe B	1,07	(0,30)
Classe C	1,07	(0,30)
Classe E	1,07	(0,29)
Classe F	1,09	(0,28)
Classe G	1,08	(0,29)
Classe I	1,37	(0,04)
Classe J	1,43	(0,04)
Classe N	1,07	(0,30)

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	13 669	19 399
Opérations sur les parts		
Parts émises	1 030	2 859
Parts rachetées	(4 636)	(8 119)
	(3 606)	(5 260)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 210	(470)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	11 273	13 669

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 210	(470)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(789)	538
Distributions par le fonds sous-jacent	(728)	(481)
	(307)	(413)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 491)	(1 132)
Cessions	5 587	6 625
	4 096	5 493
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(4)	(5)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 785	5 075
Financement		
Parts émises	1 030	2 859
Parts rachetées	(4 636)	(8 119)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 606)	(5 260)
Variation nette de la trésorerie	179	(185)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(89)	96
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	90	(89)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,39 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	17,41	195 643	1 999	1 963
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z	3,44	25	356	388
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z	8,82	65	945	994
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	21,00	90 419	1 996	2 367
Fonds américain à faible volatilité TD	18,99	100 944	1 947	2 141
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	29,73	166 670	3 416	3 351
TOTAL DES PLACEMENTS (99,39 %)			10 659	11 204
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,61 %)				69
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				11 273

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - CROISSANCE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)
Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - croissance se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

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

Obligations (30 %)

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

Actions canadiennes (21 %)

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

Actions étrangères (49 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	13 783	-	-	13 783
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	13 783	-	-	13 783

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	7 894	10 104
Trésorerie	-	32
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	7 894	10 136
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	3	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	23	36
Total du passif	26	36
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	7 868	10 100
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,10	9,81
Classe B	11,10	9,81
Classe C	11,11	9,82
Classe E	11,10	9,81
Classe F	11,12	9,82
Classe G	11,10	9,81
Classe I	11,90	10,24
Classe J	11,90	10,24
Classe N	11,10	9,81

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(120)	13
Non réalisé(e) sur les placements	768	(250)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	397	13
Total gain net (perte nette)	1 045	(224)
Distributions par le fonds sous-jacent	178	365
	1 223	141
Charges		
Frais de gestion (note 7)	209	288
Frais d'administration	8	11
Frais de transactions	-	-
	217	299
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 006	(158)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,26	(0,14)
Classe B	1,26	(0,14)
Classe C	1,27	(0,14)
Classe E	1,27	(0,14)
Classe F	1,28	(0,14)
Classe G	1,26	(0,14)
Classe I	1,64	0,12
Classe J	1,64	0,12
Classe N	1,27	(0,14)

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	10 100	11 383
Opérations sur les parts		
Parts émises	641	3 715
Parts rachetées	(3 879)	(4 840)
	(3 238)	(1 125)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 006	(158)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	7 868	10 100

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 006	(158)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(648)	237
Distributions par le fonds sous-jacent	(575)	(378)
	(217)	(299)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 164)	(2 686)
Cessions	4 597	4 124
	3 433	1 438
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(13)	5
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 203	1 144
Financement		
Parts émises	641	3 715
Parts rachetées	(3 879)	(4 840)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 238)	(1 125)
Variation nette de la trésorerie	(35)	19
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	32	13
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(3)	32
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,33 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	10,04	78 771	796	790
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z	3,48	18	251	274
Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z	6,42	33	486	505
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	24,21	72 767	1 554	1 905
Fonds américain à faible volatilité TD	18,15	67 346	1 284	1 428
FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD	38,03	148 798	2 979	2 992
TOTAL DES PLACEMENTS (100,33 %)			7 350	7 894
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,33 %)				(26)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				7 868

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS - AUDACIEUX

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes.

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

Obligations (20 %)

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

Actions canadiennes (24 %)

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

Actions étrangères (56 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	10 104	-	-	10 104
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	10 104	-	-	10 104

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ PORTEFEUILLE BÊTA INTELLIGENT PLUS

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Au 31 décembre 2021

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>FGC à faible volatilité d'actions mondiales Émeraude TD</i>	%
Public Storage	1,49
The Procter & Gamble Co.	1,48
Microsoft Corp.	1,47
Roche Holding AG-Genusschein	1,46
AusNet Services Holdings Ltd	1,42

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds américain à faible volatilité TD</i>	%
Life Storage Inc.	1,57
Atmos Energy Corp.	1,54
Nisource Inc.	1,53
The Procter & Gamble Co.	1,53
Kimberley-Clark Corp.	1,51

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds AlphaFixe RendementPlus</i>	%
Alphafixe prêts bancaires à taux variable, Série F	34,30
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	2,80
Province de l'Ontario, 3,50 %, 02-06-2024	2,24
Gouvernement du Canada, Rendement Réel, 2,00 %, 01-12-2041	2,01
Banque Royale du Canada, 3,30 %, 26-09-2023	1,35

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global High Yield Share, Classe Z</i>	%
FMG Ressources August 2006 PTY Ltd, 4,38 %, 01-04-2031	1,61
Frontier Communications Holdings LLC, 5,88 %, 15-10-2027	1,24
Antero Ressources Corp., 5,38 %, 01-03-2030	1,23
Match Group Holdings LLC, 4,63 %, 01-06-2028	1,21
NBM US Holdings Inc., 6,63 %, 06-08-2029	1,20

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds TOBAM Most Diversified Portfolio Anti-Benchmark Global Investment Share, Classe Z</i>	%
Weibo Corp., 3,50 %, 05-07-2024	1,63
Conagra Brands Inc., 4,85 %, 01-11-2028	1,37
Activision Blizzard Inc., 2,50 %, 15-09-2050	1,12
Qualcomm Inc., 4,30 %, 20-05-2047	1,12
REGS Corp., 1,63 %, 04-22-2032	1,10

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	143 462	122 501
Trésorerie	342	503
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	143 804	123 004
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	51	42
Total du passif	51	42
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	143 753	122 962
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,83	14,20
Classe B	14,41	13,80
Classe C	14,93	14,29
Classe E	14,93	14,30
Classe F	14,87	14,24
Classe G	14,78	14,15
Classe I	17,62	16,43
Classe J	17,67	16,47
Classe L	15,69	14,63
Classe N	14,93	14,29

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	4 997	27
Non réalisé(e) sur les placements	(1 775)	6 704
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	2 939	1 050
Total gain net (perte nette)	6 161	7 781
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	3 040	2 801
	9 201	10 583
Charges		
Frais de gestion (note 7)	3 124	2 902
Frais d'administration	121	112
Frais de transactions	-	2
	3 245	3 016
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 956	7 567
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,64	0,84
Classe B	0,62	0,81
Classe C	0,64	0,84
Classe E	0,64	0,85
Classe F	0,64	0,84
Classe G	0,64	0,84
Classe I	1,22	1,37
Classe J	1,21	1,38
Classe L	1,07	1,23
Classe N	0,64	0,84

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	122 962	118 163
Opérations sur les parts		
Parts émises	56 106	42 512
Parts rachetées	(41 271)	(45 280)
	14 835	(2 768)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 956	7 567
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	143 753	122 962

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 956	7 567
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(3 222)	(6 731)
Distributions par le fonds sous-jacent	(5 979)	(3 851)
	(3 245)	(3 015)
Transactions de placements		
Acquisitions	(30 465)	(20 333)
Cessions	18 705	26 507
	(11 760)	6 174
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	9	(11)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(14 996)	3 148
Financement		
Parts émises	56 106	42 512
Parts rachetées	(41 271)	(45 280)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	14 835	(2 768)
Variation nette de la trésorerie	(161)	380
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	503	123
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	342	503
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,80 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	27,45	3 932 159	39 410	39 455
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	9,96	1 130 827	14 658	14 314
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	27,44	2 854 574	39 923	39 453
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	7,02	280 151	9 258	10 097
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	10,03	550 762	11 789	14 417
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,00	77 509	3 302	4 315
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	2,99	174 596	2 860	4 304
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	5,95	217 145	5 253	8 546
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	5,96	783 974	8 307	8 561
TOTAL DES PLACEMENTS (99,80 %)			134 760	143 462
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,20 %)				291
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				143 753

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ STRATÉGIE SÉCURITAIRE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 AlphaFixe RendementPlus (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (17 %)

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

Actions étrangères (18 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	122 501	-	-	122 501
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	122 501	-	-	122 501

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILBRÉE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	251 334	240 677
Trésorerie	645	363
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	251 979	241 040
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	139	155
Total du passif	139	155
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	251 840	240 885
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,49	15,12
Classe B	16,10	14,76
Classe C	16,68	15,29
Classe E	16,68	15,29
Classe F	16,53	15,15
Classe G	16,35	14,98
Classe I	19,75	17,62
Classe J	19,75	17,62
Classe L	17,81	15,88
Classe N	16,67	15,29

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILIBRÉE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	17 567	397
Non réalisé(e) sur les placements	(2 713)	16 392
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	8 986	3 708
Total gain net (perte nette)	23 840	20 497
Intérêts aux fins d'attribution	1	2
Distributions par le fonds sous-jacent	5 362	4 794
	29 203	25 293
Charges		
Frais de gestion (note 7)	5 376	4 774
Frais d'administration	203	180
Frais de transactions	-	5
	5 579	4 959
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	23 624	20 334
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,38	1,18
Classe B	1,34	1,15
Classe C	1,39	1,19
Classe E	1,40	1,20
Classe F	1,38	1,19
Classe G	1,37	1,17
Classe I	2,15	1,80
Classe J	2,14	1,80
Classe L	1,93	1,64
Classe N	1,39	1,19

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILIBRÉE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	240 885	227 518
Opérations sur les parts		
Parts émises	64 274	48 128
Parts rachetées	(76 943)	(55 095)
	(12 669)	(6 967)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	23 624	20 334
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	251 840	240 885

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	23 624	20 334
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(14 854)	(16 789)
Distributions par le fonds sous-jacent	(14 348)	(8 502)
	(5 578)	(4 957)
Transactions de placements		
Acquisitions	(46 152)	(39 914)
Cessions	64 697	51 981
	18 545	12 067
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(16)	(10)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	12 951	7 100
Financement		
Parts émises	64 274	48 128
Parts rachetées	(76 943)	(55 095)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(12 669)	(6 967)
Variation nette de la trésorerie	282	133
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	363	230
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	645	363
Intérêts reçus	1	2
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILIBRÉE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,80 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	19,93	5 002 461	50 184	50 195
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	4,97	989 040	12 857	12 520
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	19,93	3 631 513	50 402	50 191
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	9,02	630 127	20 085	22 710
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	5,11	30 625	9 338	12 864
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	13,02	1 252 309	25 728	32 780
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,99	180 788	7 176	10 064
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	4,99	462 524	10 140	12 563
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,99	407 262	5 846	10 040
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	7,42	474 819	11 082	18 687
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	7,43	1 714 316	18 119	18 720
TOTAL DES PLACEMENTS (99,80 %)			220 957	251 334
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,20 %)				506
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				251 840

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ STRATÉGIE ÉQUILBRÉE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 AlphaFixe RendementPlus (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (27 %)

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

Actions étrangères (28 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	240 677	-	-	240 677
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	240 677	-	-	240 677

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	84 102	75 210
Trésorerie	123	583
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	3
Total de l'actif	84 225	75 796
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	96	54
Total du passif	96	54
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	84 129	75 742
Valeur liquidative, par part		
Classe A	19,87	17,66
Classe B	19,49	17,32
Classe C	20,18	17,94
Classe E	20,19	17,94
Classe F	19,94	17,72
Classe G	19,64	17,45
Classe I	24,00	20,74
Classe J	24,12	20,84
Classe L	19,51	16,86
Classe N	20,18	17,94

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	4 750	(389)
Non réalisé(e) sur les placements	1 824	5 622
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	3 689	1 285
Total gain net (perte nette)	10 263	6 518
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	1 658	1 344
	11 921	7 863
Charges		
Frais de gestion (note 7)	1 717	1 408
Frais d'administration	63	52
Frais de transactions	-	2
	1 780	1 462
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	10 141	6 401
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	2,20	1,50
Classe B	2,16	1,47
Classe C	2,24	1,52
Classe E	2,25	1,52
Classe F	2,22	1,51
Classe G	2,18	1,48
Classe I	3,29	2,26
Classe J	3,28	2,27
Classe L	2,65	1,85
Classe N	2,24	1,52

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	75 742	63 534
Opérations sur les parts		
Parts émises	15 735	19 431
Parts rachetées	(17 489)	(13 624)
	(1 754)	5 807
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	10 141	6 401
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	84 129	75 742

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	10 141	6 401
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(6 574)	(5 233)
Distributions par le fonds sous-jacent	(5 347)	(2 629)
	(1 780)	(1 461)
Transactions de placements		
Acquisitions	(12 152)	(17 261)
Cessions	15 181	13 270
	3 029	(3 991)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	45	3
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	1 294	(5 449)
Financement		
Parts émises	15 735	19 431
Parts rachetées	(17 489)	(13 624)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 754)	5 807
Variation nette de la trésorerie	(460)	358
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	583	225
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	123	583
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (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 AlphaFixe RendementPlus	14,97	1 254 772	12 641	12 590
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	14,97	910 905	12 771	12 590
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	10,03	234 179	7 553	8 440
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	6,14	12 292	3 645	5 163
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	15,04	483 302	9 842	12 651
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	8,00	120 938	4 909	6 732
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	5,99	185 624	4 037	5 042
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	7,98	272 381	4 154	6 715
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	8,42	179 976	4 243	7 083
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	8,43	649 787	6 865	7 096
TOTAL DES PLACEMENTS (99,97 %)			70 660	84 102
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,03 %)				27
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				84 129

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ STRATÉGIE CROISSANCE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 AlphaFixe RendementPlus (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (31 %)

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

Actions étrangères (39 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	75 210	-	-	75 210
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	75 210	-	-	75 210

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	45 877	40 475
Trésorerie	52	19
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	45 929	40 494
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	100	95
Total du passif	100	95
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	45 829	40 399
Valeur liquidative, par part		
Classe A	19,19	16,69
Classe B	18,73	16,30
Classe C	19,49	16,96
Classe E	19,50	16,96
Classe F	19,24	16,72
Classe G	18,89	16,43
Classe I	23,34	19,72
Classe J	23,46	19,82
Classe L	20,97	17,71
Classe N	19,49	16,96

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2 931	(97)
Non réalisé(e) sur les placements	1 131	3 624
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	2 229	717
Total gain net (perte nette)	6 291	4 244
Distributions par le fonds sous-jacent	846	686
	7 137	4 930
Charges		
Frais de gestion (note 7)	985	854
Frais d'administration	35	30
Frais de transactions	-	1
	1 020	885
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 117	4 045
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	2,49	1,60
Classe B	2,43	1,57
Classe C	2,53	1,63
Classe E	2,53	1,63
Classe F	2,51	1,62
Classe G	2,45	1,58
Classe I	3,74	2,38
Classe J	3,64	2,40
Classe L	3,25	2,15
Classe N	2,53	1,63

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	40 399	34 707
Opérations sur les parts		
Parts émises	7 021	7 890
Parts rachetées	(7 708)	(6 243)
	(687)	1 647
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 117	4 045
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	45 829	40 399

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 117	4 045
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(4 062)	(3 527)
Distributions par le fonds sous-jacent	(3 075)	(1 403)
	(1 020)	(885)
Transactions de placements		
Acquisitions	(8 180)	(10 406)
Cessions	9 915	9 668
	1 735	(738)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	5	15
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	720	(1 608)
Financement		
Parts émises	7 021	7 890
Parts rachetées	(7 708)	(6 243)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(687)	1 647
Variation nette de la trésorerie	33	39
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	19	(20)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	52	19
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,10 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	9,99	456 259	4 583	4 578
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	9,99	331 259	4 641	4 578
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	11,05	140 479	4 575	5 063
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	7,17	7 822	2 395	3 285
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	17,06	298 737	6 271	7 820
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	8,01	65 978	2 758	3 673
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	7,00	118 116	2 603	3 208
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	7,99	148 567	2 407	3 663
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	10,91	127 052	3 073	5 000
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	10,93	458 697	4 849	5 009
TOTAL DES PLACEMENTS (100,10 %)			38 155	45 877
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,10 %)				(48)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				45 829

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ STRATÉGIE AUDACIEUSE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 AlphaFixe RendementPlus (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (35 %)

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

Actions étrangères (45 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	40 475	-	-	40 475
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	40 475	-	-	40 475

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

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

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL		2021
Exercice terminé le 31 décembre		\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements		-
Non réalisé(e) sur les placements		1
Distribué(e) par le fonds sous-jacent		3
Total gain net (perte nette)		4
Distributions par le fonds sous-jacent		1
		5
Charges		
Frais de gestion (note 7)		1
Frais d'administration		-
Frais de transactions		-
		1
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs		4
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A		0,86
Classe B		0,86
Classe E		0,87
Classe F		0,86
Classe G		0,86
Classe I		1,05
Classe J		1,05
Classe L		1,05
Classe N		0,86

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercice terminé le 31 décembre

2021

	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	-
Opérations sur les parts	
Parts émises	47
Parts rachetées	-
	47
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	51

ÉTAT DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercice terminé le 31 décembre

2021

	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:	
Opérationnelles	
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4
Éléments sans incidence sur la trésorerie	
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1)
Distributions par le fonds sous-jacent	(4)
	(1)
Transactions de placements	
Acquisitions	(47)
Cessions	1
	(46)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(47)
Financement	
Parts émises	47
Parts rachetées	-
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	47
Variation nette de la trésorerie	-
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	-
Intérêts reçus	-
Dividendes reçus	-

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,00 %)				
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	13,73	197	7	7
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	9,80	11	5	5
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	21,57	406	11	11
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	9,80	91	5	5
Fonds Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	7,84	150	4	4
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	9,80	204	5	5
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	13,73	178	6	7
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	13,73	642	7	7
TOTAL DES PLACEMENTS (100,00 %)			50	51
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,00 %)				-
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				51

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ STRATÉGIE 100% ACTIONS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Stratégie 100% actions se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

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

Actions canadiennes (44 %)

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

Actions étrangères (56 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

Au cours de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	75 467	79 373
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	684	75
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	76 151	79 448
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	707	101
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	23	30
Total du passif	730	131
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	75 421	79 317
Valeur liquidative, par part		
Classe A	14,51	13,64
Classe B	14,11	13,26
Classe C	14,62	13,74
Classe E	14,62	13,74
Classe F	14,54	13,67
Classe G	14,43	13,56
Classe I	17,38	15,88
Classe J	17,44	15,94
Classe N	14,62	13,74

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2 333	(517)
Non réalisé(e) sur les placements	665	2 559
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1 755	540
Total gain net (perte nette)	4 753	2 582
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 167	2 497
	6 920	5 080
Charges		
Frais de gestion (note 7)	2 064	2 184
Frais d'administration	76	81
Frais de transactions	-	-
	2 140	2 265
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 780	2 815
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,87	0,45
Classe B	0,85	0,43
Classe C	0,88	0,45
Classe E	0,88	0,45
Classe F	0,88	0,45
Classe G	0,87	0,45
Classe I	1,52	0,93
Classe J	1,51	0,93
Classe N	0,88	0,45

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	79 317	87 543
Opérations sur les parts		
Parts émises	14 094	15 043
Parts rachetées	(22 770)	(26 084)
	(8 676)	(11 041)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 780	2 815
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	75 421	79 317

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 780	2 815
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 998)	(2 042)
Distributions par le fonds sous-jacent	(3 922)	(3 037)
	(2 140)	(2 264)
Transactions de placements		
Acquisitions	(3 806)	(9 560)
Cessions	14 023	22 411
	10 217	12 851
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(7)	7
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	8 070	10 594
Financement		
Parts émises	14 094	15 043
Parts rachetées	(22 770)	(26 084)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(8 676)	(11 041)
Variation nette de la trésorerie	(606)	(447)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(101)	346
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(707)	(101)
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,06 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	14,06	1 057 101	10 557	10 607
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I	8,03	567 660	6 154	6 058
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	12,07	653 625	9 314	9 101
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	10,04	598 044	7 767	7 570
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	16,12	879 804	12 248	12 160
Fonds Guardian Equity Income, Série I	8,00	280 853	4 741	6 033
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	5,97	124 985	3 920	4 504
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	5,97	171 935	3 555	4 501
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,94	53 310	2 159	2 969
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,96	121 299	1 839	2 990
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	3,02	57 891	1 590	2 278
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	2,96	204 422	2 159	2 232
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	5,92	334 087	4 438	4 464
TOTAL DES PLACEMENTS (100,06 %)			70 441	75 467
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,06 %)				(46)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				75 421

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ CELESTIA SÉCURITAIRE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 AlphaFixe RendementPlus (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 114)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (20 %)

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

Actions étrangères (20 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	79 373	-	-	79 373
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	79 373	-	-	79 373

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	110 188	110 826
Trésorerie	770	-
Cession de placements à recevoir	-	185
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	110 958	111 011
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	220
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	77	90
Total du passif	77	310
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	110 881	110 701
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,46	13,86
Classe B	15,13	13,57
Classe C	15,68	14,06
Classe E	15,68	14,06
Classe F	15,54	13,92
Classe G	15,33	13,74
Classe I	18,72	16,30
Classe J	18,82	16,39
Classe N	15,67	14,05

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2 662	(1 098)
Non réalisé(e) sur les placements	5 922	346
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	3 372	684
Total gain net (perte nette)	11 956	(68)
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 988	3 425
	14 944	3 358
Charges		
Frais de gestion (note 7)	2 957	3 150
Frais d'administration	105	113
Frais de transactions	-	-
	3 062	3 263
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	11 882	95
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,61	-
Classe B	1,57	-
Classe C	1,63	-
Classe E	1,63	-
Classe F	1,62	0,01
Classe G	1,60	0,01
Classe I	2,44	0,44
Classe J	2,45	0,44
Classe N	1,63	-

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	110 701	131 759
Opérations sur les parts		
Parts émises	19 400	14 066
Parts rachetées	(31 102)	(35 219)
	(11 702)	(21 153)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	11 882	95
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	110 881	110 701

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	11 882	95
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(8 584)	752
Distributions par le fonds sous-jacent	(6 360)	(4 109)
	(3 062)	(3 262)
Transactions de placements		
Acquisitions	(12 157)	(12 736)
Cessions	27 924	37 077
	15 767	24 341
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(13)	(9)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	12 692	21 070
Financement		
Parts émises	19 400	14 066
Parts rachetées	(31 102)	(35 219)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(11 702)	(21 153)
Variation nette de la trésorerie	990	(83)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(220)	(137)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	770	(220)
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (99,38 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	7,93	875 821	8 757	8 788
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I	6,44	668 962	7 279	7 139
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	9,93	790 849	11 263	11 012
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K	4,95	432 897	5 626	5 480
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	10,40	834 515	11 589	11 534
Fonds Guardian Equity Income, Série I	11,99	619 074	10 529	13 298
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	8,96	275 779	8 824	9 939
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	8,96	379 472	7 790	9 933
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	3,97	79 147	3 126	4 406
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	3,96	178 226	2 460	4 394
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	2,95	83 144	2 281	3 272
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	2,96	300 154	3 170	3 277
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	5,95	493 204	6 616	6 590
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	5,01	251 496	4 826	5 560
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	5,02	171 675	5 147	5 566
TOTAL DES PLACEMENTS (99,38 %)			99 283	110 188
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,62 %)				693
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				110 881

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ CELESTIA ÉQUILIBRÉ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 AlphaFixe RendementPlus (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 114)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital, Classe K (page 8)	Corporation Fiera Capital
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (30 %)

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

Actions étrangères (20 %)

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

Fonds spécialisés (10 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	110 826	-	-	110 826
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	110 826	-	-	110 826

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	45 747	40 736
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	-	70
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	45 747	40 806
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	160	103
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	61	62
Total du passif	221	165
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	45 526	40 641
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,63	14,42
Classe B	16,33	14,15
Classe C	16,90	14,66
Classe E	16,92	14,67
Classe F	16,70	14,47
Classe G	16,43	14,25
Classe I	20,23	17,04
Classe J	20,37	17,15
Classe N	16,90	14,65

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 195	(714)
Non réalisé(e) sur les placements	3 161	(382)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1 657	243
Total gain net (perte nette)	6 013	(853)
Distributions par le fonds sous-jacent	1 156	1 230
	7 169	377
Charges		
Frais de gestion (note 7)	1 191	1 203
Frais d'administration	42	42
Frais de transactions	-	-
	1 233	1 245
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 936	(868)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	2,19	(0,28)
Classe B	2,15	(0,27)
Classe C	2,22	(0,28)
Classe E	2,23	(0,28)
Classe F	2,21	(0,27)
Classe G	2,17	(0,27)
Classe I	3,20	0,14
Classe J	3,20	0,14
Classe N	2,22	(0,28)

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	40 641	50 186
Opérations sur les parts		
Parts émises	14 759	5 173
Parts rachetées	(15 810)	(13 850)
	(1 051)	(8 677)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 936	(868)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	45 526	40 641

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 936	(868)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(4 356)	1 096
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 813)	(1 473)
	(1 233)	(1 245)
Transactions de placements		
Acquisitions	(10 146)	(4 812)
Cessions	12 374	14 724
	2 228	9 912
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1)	(10)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	994	8 657
Financement		
Parts émises	14 759	5 173
Parts rachetées	(15 810)	(13 850)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 051)	(8 677)
Variation nette de la trésorerie	(57)	(20)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(103)	(83)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(160)	(103)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,49 %)				
Fonds AlphaFixe RendementPlus	5,50	249 787	2 499	2 506
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I	5,01	213 517	2 321	2 279
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	7,03	229 715	3 265	3 199
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	7,51	247 295	3 426	3 418
Fonds Guardian Equity Income, Série I	15,66	331 712	5 850	7 126
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	11,07	139 867	4 589	5 041
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	11,07	192 480	4 073	5 038
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	4,52	36 943	1 462	2 056
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	4,50	83 173	1 268	2 050
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	3,97	45 972	1 303	1 809
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	3,98	166 024	1 757	1 813
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	8,51	289 858	3 875	3 874
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	6,08	125 212	2 412	2 768
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	6,08	85 452	2 588	2 770
TOTAL DES PLACEMENTS (100,49 %)			40 688	45 747
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,49 %)				(221)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				45 526

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ CELESTIA CROISSANCE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 AlphaFixe RendementPlus (page 114)	AlphaFixe Capital
Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I (page 114)	Gestion mondiale d'actifs CI
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I (page 114)	PIMCO Canada
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K (page 13)	Corporation Fiera Capital

Actions canadiennes (37,5 %)

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

Actions étrangères (25,5 %)

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

Fonds spécialisés (12 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	40 736	-	-	40 736
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	40 736	-	-	40 736

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	32 291	31 184
Trésorerie	16	-
Cession de placements à recevoir	-	100
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	32 307	31 284
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	171
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	89	89
Total du passif	89	260
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	32 218	31 024
Valeur liquidative, par part		
Classe A	17,28	14,53
Classe B	16,85	14,18
Classe C	17,53	14,75
Classe D	16,85	14,18
Classe E	17,56	14,77
Classe F	17,24	14,50
Classe G	16,84	14,17
Classe H	16,46	13,85
Classe I	21,05	17,19
Classe J	21,21	17,32
Classe N	17,53	14,75

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 442	(306)
Non réalisé(e) sur les placements	2 682	54
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	1 416	164
Total gain net (perte nette)	5 540	(88)
Distributions par le fonds sous-jacent	788	836
	6 328	748
Charges		
Frais de gestion (note 7)	874	829
Frais d'administration	30	29
Frais de transactions	-	-
	904	858
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 424	(110)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	2,74	(0,06)
Classe B	2,67	(0,06)
Classe C	2,78	(0,07)
Classe D	2,66	(0,06)
Classe E	2,80	(0,06)
Classe F	2,74	(0,06)
Classe G	2,68	(0,06)
Classe H	2,61	(0,06)
Classe I	3,89	0,39
Classe J	3,91	0,40
Classe N	2,79	(0,07)

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	31 024	32 624
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 075	6 469
Parts rachetées	(10 305)	(7 959)
	(4 230)	(1 490)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 424	(110)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	32 218	31 024

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	5 424	(110)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(4 124)	252
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 204)	(1 000)
	(904)	(858)
Transactions de placements		
Acquisitions	(6 666)	(6 730)
Cessions	11 987	8 815
	5 321	2 085
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-	8
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	4 417	1 235
Financement		
Parts émises	6 075	6 469
Parts rachetées	(10 305)	(7 959)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(4 230)	(1 490)
Variation nette de la trésorerie	187	(255)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(171)	84
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	16	(171)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,23 %)				
Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I	5,00	115 764	1 639	1 612
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital, Classe K	4,99	116 317	1 634	1 608
Fonds Guardian Equity Income, Série I	18,12	271 769	4 709	5 838
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	13,54	121 063	3 877	4 363
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	13,53	166 583	3 543	4 360
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	6,00	34 741	1 395	1 934
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	5,99	78 262	1 140	1 929
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	4,46	36 489	1 029	1 436
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	4,47	131 750	1 393	1 439
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	9,98	240 522	3 224	3 214
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	7,07	103 046	1 984	2 278
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	7,08	70 324	2 111	2 280
TOTAL DES PLACEMENTS (100,23 %)			27 678	32 291
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,23 %)				(73)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				32 218

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ CELESTIA AUDACIEUX

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

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

Obligations (10 %)

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

Actions canadiennes (45 %)

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

Actions étrangères (31 %)

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

Fonds spécialisés (14 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	31 184	-	-	31 184
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	31 184	-	-	31 184

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

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

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL		2021
Exercice terminé le 31 décembre		\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements		-
Non réalisé(e) sur les placements		(4)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent		12
Total gain net (perte nette)		8
Distributions par le fonds sous-jacent		4
		12
Charges		
Frais de gestion (note 7)		2
Frais d'administration		-
Frais de transactions		-
		2
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs		10
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A		0,75
Classe B		0,75
Classe E		0,76
Classe F		0,75
Classe G		0,75
Classe I		0,94
Classe J		0,94
Classe N		0,75

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercice terminé le 31 décembre	2021
	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	-
Opérations sur les parts	
Parts émises	293
Parts rachetées	(11)
	282
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	10
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	292

ÉTAT DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercice terminé le 31 décembre	2021
	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:	
Opérationnelles	
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	10
Éléments sans incidence sur la trésorerie	
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	4
Distributions par le fonds sous-jacent	(16)
	(2)
Transactions de placements	
Acquisitions	(284)
Cessions	4
	(280)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(282)
Financement	
Parts émises	293
Parts rachetées	(11)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	282
Variation nette de la trésorerie	-
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	-
Intérêts reçus	-
Dividendes reçus	-

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Pourcentage de l'actif net	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
	%		\$	\$
PLACEMENTS (100,00 %)				
Fonds Guardian Equity Income, Série I	20,21	2 731	58	59
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	15,07	1 215	47	44
Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima, Classe K	15,07	1 673	48	44
Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale, Classe K	6,51	341	20	19
Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide, Classe K	6,51	765	19	19
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	4,79	367	13	14
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	4,79	1 322	14	14
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	10,95	2 393	31	32
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	7,88	1 066	22	23
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	8,22	728	24	24
TOTAL DES PLACEMENTS (100,00 %)			296	292
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,00 %)				-
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)				292

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS (non audités)

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

FONDS SSQ CÉLESTIA 100% ACTIONS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Celestia 100 % actions se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Les fonds sous-jacents sont gérés activement par les gestionnaires externes selon une méthode de gestion qui est propre à chacun.

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

Actions canadiennes (50 %)

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

Actions étrangères (34 %)

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

Fonds spécialisés (16 %)

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

Juste valeur des instruments financiers

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

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

Au cours de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ STRATÉGIE & FONDS SSQ CELESTIA

PRINCIPAUX TITRES DES FONDS SOUS-JACENTS

Au 31 décembre 2021

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD</i>	%
Broadcom Inc.	2,25
AbbVie Inc.	2,11
Microsoft Corp.	2,04
Cisco Systems Inc.	2,04
Intl Business Machines Corp.	1,91

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust</i>	%
Ashtead Group PLC	4,02
HubSpot Inc.	3,84
Align Technology Inc.	3,69
SVB Financial Group	3,31
Dominos Pizza Inc.	3,16

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I</i>	%
Prologis Inc.	5,44
Tricon Residential Inc.	5,43
American Homes 4 Rent, Catégorie A	4,80
Alexandria Real Estate Equities Inc.	4,47
ESR Cayman Ltd	3,64

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds obligations de sociétés CI, Catégorie I</i>	%
Dresdner Funding Trust I, 8,15 %, 30-06-2031	1,22
Fairfax India Holdings, 5,00 %, 26-02-2028	0,96
Inter Pipeline Ltd, 6,63 %, 19-11-2079	0,69
Inter Pipeline Ltd, 6,88 %, 26-03-2079	0,66
Barclay's Bank PLC, 6,28 %, 15-12-2034	0,64

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser</i>	%
Fonds d'actions spéciales Jarislowsky Fraser	7,12
Chemins de fer nationaux du Canada	7,10
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	6,77
Banque de Nouvelle-Écosse	6,07
Nutrien Ltd	4,28

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds de revenu mensuel PIMCO (Canada), Série I</i>	%
Fannie Mae TBA, 3,50 %, 01-03-2052	7,99
Fannie Mae TBA, 4,00 %, 01-02-2052	2,91
Citigroup Mortgage Loan Trust, 0,00 %, 01-11-2061	2,29
Fannie Mae TBA, 4,00 %, 01-01-2052	1,95
Jamestown Residential DAC, 0,29 %, 24-06-2059	1,87

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"</i>	%
ATS Automation Tooling Systems Inc.	4,10
Enerplus Corp.	4,01
Aritzia Inc.	3,44
StorageVault Canada Inc.	3,30
Colliers International Group Inc.	3,18

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A</i>	%
Moody's Corp.	6,73
Alphabet Inc., Catégorie A	6,68
Microsoft Corp.	6,17
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	4,66
MasterCard Inc., Catégorie A	4,09

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I</i>	%
Alphabet Inc., Catégorie C	6,89
UnitedHealth Group Inc.	5,26
Microsoft Corp.	4,39
Wal-Mart Inc.	4,13
Visa Inc., Catégorie A	4,05

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds AlphaFixe RendementPlus</i>	%
Alphafixe prêts bancaires à taux variable, Série F	34,30
Province de l'Ontario, 2,60 %, 02-06-2025	2,80
Province de l'Ontario, 3,50 %, 02-06-2024	2,24
Gouvernement du Canada, Rendement Réel, 2,00 %, 01-12-2041	2,01
Banque Royale du Canada, 3,30 %, 26-09-2023	1,35

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds Guardian Equity Income, Série I</i>	%
Banque Royale du Canada	7,04
Banque Toronto-Dominion	6,84
Banque de Nouvelle-Écosse	5,47
Canadian Natural Resources Ltd	4,52
Banque de Montréal	4,37

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)	
<i>Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)</i>	%
National Grid PLC	8,66
Vinci SA	8,27
Ferrovial SA	8,20
Snam SpA	7,78
Terna SpA	6,32

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	24 495	25 447
Trésorerie	27	-
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	24 522	25 447
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	1
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	4	4
Total du passif	4	5
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	24 518	25 442
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,68	10,11
Classe B	10,26	9,71
Classe C	10,79	10,22
Classe E	10,81	10,23
Classe F	10,71	10,14
Classe G	10,60	10,03
Classe I	12,92	11,90
Classe J	14,96	13,78
Classe L	15,23	14,02
Classe N	10,80	10,22

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	434	247
Non réalisé(e) sur les placements	45	1 037
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	986	218
Total gain net (perte nette)	1 465	1 502
Distributions par le fonds sous-jacent	573	666
	2 038	2 168
Charges		
Frais de gestion (note 7)	626	675
Frais d'administration	24	25
Frais de transactions	-	-
	650	700
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 388	1 468
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,56	0,52
Classe B	0,54	0,50
Classe C	0,57	0,53
Classe E	0,57	0,53
Classe F	0,57	0,53
Classe G	0,57	0,52
Classe I	1,01	0,91
Classe J	1,17	1,06
Classe L	1,19	1,08
Classe N	0,57	0,54

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	25 442	27 194
Opérations sur les parts		
Parts émises	5 846	6 324
Parts rachetées	(8 158)	(9 544)
	(2 312)	(3 220)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 388	1 468
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	24 518	25 442

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 388	1 468
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(479)	(1 284)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 559)	(884)
	(650)	(700)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 260)	(1 340)
Cessions	4 250	5 035
	2 990	3 695
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-	(1)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	2 340	2 994
Financement		
Parts émises	5 846	6 324
Parts rachetées	(8 158)	(9 544)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(2 312)	(3 220)
Variation nette de la trésorerie	28	(226)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(1)	225
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	27	(1)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,91 %)			
Guardian Managed Yield Portfolio Fund, Série I	2 148 703	<u>22 554</u>	<u>24 495</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,09 %)			<u>23</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>24 518</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Guardian Managed Yield Portfolio Fund, Série I</i>	%
Guardian Short Duration Bond Fund, Série I	15,15
Guardian Canadian Bond Fund, Série I	14,76
Guardian Global Dividend Growth Fund, Série I	12,69
Guardian Investment Grade Corp Bond Fund, Série I	11,47
Guardian Canadian Equity Fund, Série I	9,76
Guardian Fundamental Global Equity Fund, Série I	7,30
Guardian Strategic Income Fund, Série I	6,57
Guardian Directed Premium Yield, Série I	3,64
Guardian Canadian Equity Select Fund, Série I	3,17
Guardian Canadian Growth Equity Fund, Série I	2,84
Guardian Emerging Markets Equity, Série I	2,75
Guardian Canadian Focused Equity Fund, Série I	2,44
Guardian U.S. Equity All Cap Growth Fund, Série I	2,23
Guardian Global REIT Unhedged ETF	1,91
Quadratic Interest Rate Volatility and Inflation Hedge ETF	1,79
Guardian Directed Premium Yield Unhedged	1,42

FONDS SSQ REVENU SÉCURITAIRE GUARDIAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu sécuritaire Guardian est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Guardian Managed Yield Portfolio, Série I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu sécuritaire Guardian se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Guardian Capital LP. Le gestionnaire utilise une stratégie de gestion qui intègre les approches de répartition de l'actif stratégique et tactique qui donnent la possibilité à celui-ci de profiter des opportunités de marché à mesure qu'elles surviennent. L'actif du fonds est composé d'environ 60 % de titres à revenu fixe et d'environ 40 % de titres à revenu variable.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	25 447	-	-	25 447
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	25 447	-	-	25 447

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	31 384	32 469
Trésorerie	152	311
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	31 536	32 780
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	12	11
Total du passif	12	11
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	31 524	32 769
Valeur liquidative, par part		
Classe A	11,42	10,31
Classe B	11,02	9,94
Classe C	11,62	10,49
Classe E	11,64	10,51
Classe F	11,49	10,37
Classe G	11,29	10,19
Classe I	13,93	12,23
Classe J	16,12	14,15
Classe L	16,44	14,43
Classe N	11,73	10,59

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	942	418
Non réalisé(e) sur les placements	2 273	816
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	198	-
Total gain net (perte nette)	3 413	1 234
Distributions par le fonds sous-jacent	697	786
	4 110	2 020
Charges		
Frais de gestion (note 7)	800	857
Frais d'administration	30	32
Frais de transactions	-	-
	830	889
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 280	1 131
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,11	0,31
Classe B	1,08	0,30
Classe C	1,13	0,32
Classe E	1,13	0,32
Classe F	1,12	0,32
Classe G	1,10	0,32
Classe I	1,70	0,68
Classe J	1,97	0,79
Classe L	2,00	0,81
Classe N	1,13	0,32

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	32 769	38 206
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 376	9 885
Parts rachetées	(12 901)	(16 453)
	(4 525)	(6 568)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 280	1 131
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	31 524	32 769

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 280	1 131
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(3 215)	(1 234)
Distributions par le fonds sous-jacent	(895)	(786)
	(830)	(889)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 430)	(1 750)
Cessions	6 625	9 570
	5 195	7 820
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1	(12)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	4 366	6 919
Financement		
Parts émises	8 376	9 885
Parts rachetées	(12 901)	(16 453)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(4 525)	(6 568)
Variation nette de la trésorerie	(159)	351
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	311	(40)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	152	311
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,56 %)			
Guardian Managed Income & Growth Portfolio Fund, Série I	2 368 596	<u>25 654</u>	<u>31 384</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,44 %)			<u>140</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>31 524</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Guardian Managed Income & Growth Portfolio Fund, Série I</i>	%
Guardian Canadian Equity Fund, Série I	19,28
Guardian i3 Global Dividend Growth Fund, Série I	18,82
Guardian Fundamental Global Equity Fund, Série I	10,82
Guardian Investment Grade Corp Bond Fund, Série I	9,96
Guardian Strategic Income Fund, Série I	8,76
Guardian Canadian Bond Fund, Série I	5,00
Guardian Directed Premium Yield, Série I	4,30
Guardian Emerging Markets Equity, Série I	4,12
Guardian Canadian Growth Equity Fund, Série I	3,90
Guardian Canadian Equity Select Fund, Série I	3,83
Guardian Short Duration Bond Fund, Série I	3,83
Guardian Global REIT Unhedged ETF	2,59
Guardian U.S. Equity All Cap Growth Fund	1,72
Guardian Directed Premium Yield Unhedged	1,65
Quadratic Interest Rate Volatility and Inflation Hedge ETF	0,96
Guardian Canadian Bond ETF Units	0,44

FONDS SSQ REVENU GUARDIAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Revenu Guardian est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Guardian Managed Income & Growth Portfolio, Série I. Par conséquent, le Fonds SSQ Revenu Guardian se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Guardian Capital LP. Le gestionnaire utilise une stratégie de gestion qui intègre les approches de répartition de l'actif stratégique et tactique qui donnent la possibilité à celui-ci de profiter des opportunités de marché à mesure qu'elles surviennent. L'actif du fonds est composé d'environ 40 % de titres à revenu fixe et d'environ 60 % de titres à revenu variable.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	32 469	-	-	32 469
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	32 469	-	-	32 469

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, 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 (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	74 515	77 357
Trésorerie	101	-
Cession de placements à recevoir	-	275
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	74 616	77 632
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	142
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	96	104
Total du passif	96	246
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	74 520	77 386
Valeur liquidative, par part		
Classe A	8,21	7,52
Classe B	8,03	7,35
Classe C	8,35	7,65
Classe E	8,38	7,67
Classe F	8,21	7,51
Classe G	7,99	7,31
Classe I	10,02	8,92
Classe J	11,71	10,43
Classe L	16,83	14,98
Classe N	8,35	7,64

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 547	1 389
Non réalisé(e) sur les placements	6 179	(2 351)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	371	4 053
Total gain net (perte nette)	8 097	3 091
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	661	263
	8 758	3 355
Charges		
Frais de gestion (note 7)	1 867	2 035
Frais d'administration	70	77
Frais de transactions	-	-
	1 937	2 112
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 821	1 243
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,69	0,09
Classe B	0,68	0,09
Classe C	0,70	0,09
Classe E	0,71	0,10
Classe F	0,70	0,10
Classe G	0,68	0,09
Classe I	1,10	0,34
Classe J	1,29	0,40
Classe L	1,85	0,58
Classe N	0,70	0,09

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	77 386	93 422
Opérations sur les parts		
Parts émises	10 030	9 206
Parts rachetées	(19 717)	(26 485)
	(9 687)	(17 279)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 821	1 243
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	74 520	77 386

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 821	1 243
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(7 726)	962
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 032)	(4 316)
	(1 937)	(2 111)
Transactions de placements		
Acquisitions	-	-
Cessions	11 875	19 340
	11 875	19 340
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(8)	(10)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	9 930	17 219
Financement		
Parts émises	10 030	9 206
Parts rachetées	(19 717)	(26 485)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(9 687)	(17 279)
Variation nette de la trésorerie	243	(60)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(142)	(82)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	101	(142)
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,99 %)			
Fonds catégorie de société canadienne de répartition de l'actif CI, Catégorie O	4 151 041	60 868	74 515
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,01 %)			5
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			74 520

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

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

Catégorie O	%
Cambridge Canadian Core Plus Bond Pool, Catégorie I	32,89
Cambridge Canadian Long-Term Bond Pool, Catégorie I	3,19
Cambridge Canadian Short-Term Bond Pool, Catégorie I	3,05
Anthem Inc.	1,78
Microsoft Corp.	1,68
Alphabet Inc., Catégorie A	1,54
Ferguson PLC	1,53
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	1,44
Visa Inc., Catégorie A	1,44
Berry Global Group Inc.	1,43
Athene Holding Ltd, Catégorie A	1,43
Meta Platforms Inc., Catégorie A	1,41
Ashtead Group PLC	1,41
DuPont De Nemours Inc.	1,39
Amazon.com Inc.	1,26
Danaher Corp.	1,24
Banque Royale du Canada	1,22
Enbridge Inc.	1,21
Philip Morris International Inc.	1,17
Canadian Pacific Kansas City Ltd	1,12
CGI Inc., Catégorie A	1,06
McKesson Corp.	1,06
Constellation Software Inc.	1,02
CIBC	1,00
Alimentation Couche-Tard Inc., Catégorie A	0,99

FONDS SSQ RÉPARTITION D'ACTIFS CANADIENS CI CAMBRIDGE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 CI, 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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement du gestionnaire est de repérer des sociétés qui présentent une bonne valeur et des possibilités de croissance dans leur secteur d'activité. Il tient également compte de facteurs comme la pénétration du marché, les prévisions de bénéfices et la qualité de la direction.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	77 357	-	-	77 357
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	77 357	-	-	77 357

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, 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 (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	234 602	194 730
Trésorerie	682	-
Cession de placements à recevoir	-	370
Autres débiteurs	1	-
Total de l'actif	235 285	195 100
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	218
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	230	112
Total du passif	230	330
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	235 055	194 770
Valeur liquidative, par part		
Classe A	8,00	7,10
Classe B	7,80	6,92
Classe C	8,14	7,23
Classe E	8,17	7,25
Classe F	7,98	7,08
Classe G	7,76	6,89
Classe I	10,04	8,64
Classe J	12,07	10,38
Classe L	21,93	18,85
Classe N	8,14	7,22

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	809	1 598
Non réalisé(e) sur les placements	20 284	11 285
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	7 923	8 805
Total gain net (perte nette)	29 016	21 688
Intérêts aux fins d'attribution	1	2
Distributions par le fonds sous-jacent	3 731	3 330
	32 748	25 020
Charges		
Frais de gestion (note 7)	5 713	4 740
Frais d'administration	187	155
Frais de transactions	-	-
	5 900	4 895
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	26 848	20 125
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,90	0,71
Classe B	0,88	0,69
Classe C	0,92	0,72
Classe E	0,92	0,73
Classe F	0,90	0,71
Classe G	0,88	0,69
Classe I	1,41	1,11
Classe J	1,70	1,32
Classe L	3,08	2,42
Classe N	0,91	0,72

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	194 770	181 364
Opérations sur les parts		
Parts émises	57 112	54 646
Parts rachetées	(43 675)	(61 365)
	13 437	(6 719)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	26 848	20 125
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	235 055	194 770

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	26 848	20 125
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(21 093)	(12 883)
Distributions par le fonds sous-jacent	(11 654)	(12 135)
	(5 899)	(4 893)
Transactions de placements		
Acquisitions	(11 865)	(10 335)
Cessions	5 110	21 945
	(6 755)	11 610
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	117	(8)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(12 537)	6 709
Financement		
Parts émises	57 112	54 646
Parts rachetées	(43 675)	(61 365)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	13 437	(6 719)
Variation nette de la trésorerie	900	(10)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(218)	(208)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	682	(218)
Intérêts reçus	1	2
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,81 %)			
Fonds mondial de croissance et de revenu CI, Catégorie I	20 376 764	<u>187 940</u>	<u>234 602</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,19 %)			<u>453</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>235 055</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>FondsI mondial de croissance et de revenu CI, Catégorie I</i>	%
Titres du trésor des États-Unis, 0,38 %, 31-10-2023	4,21
Titres du trésor des États-Unis, 1,13 %, 31-10-2026	2,72
Titres du trésor des États-Unis, 1,88 %, 15-11-2051	2,30
Advanced Micro Devices	2,25
Microsoft Corp.	1,82
Apple Inc.	1,64
STMicroelectronics NV	1,39
NVIDIA Corp.	1,38
Prologis Inc.	1,09
Anglo American PLC	1,09
Royal Dutch Shell PLC, Catégorie A	1,06
Titres du trésor des États-Unis, 1,38 %, 15-11-2031	1,04
Synchrony Financial	0,95
Sony Corp.	0,95
Mastercard Inc., Catégorie A	0,92
East West Bancorp Inc.	0,90
Citigroup Inc.	0,86
UnitedHealth Group Inc.	0,85
Micron Technology Inc.	0,83
Keyence Corp.	0,76
Home Depot Inc.	0,72
Unity Software Inc.	0,71
Williams Companies Inc.	0,71
Equitable Holdings Inc.	0,70
Alphabet Inc., Catégorie C	0,70

FONDS SSQ REVENU ET CROISSANCE MONDIAL CI SIGNATURE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 CI, 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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement combine une analyse macroéconomique descendante et une analyse de données fondamentales ascendante pour la sélection des titres.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	194 730	-	-	194 730
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	194 730	-	-	194 730

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	67 162	62 161
Trésorerie	-	12 870
Cession de placements à recevoir	155	185
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	67 317	75 216
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	130	-
Achat de placements à payer	-	13 010
Autres créditeurs	33	40
Total du passif	163	13 050
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	67 154	62 166
Valeur liquidative, par part		
Classe A	16,57	13,07
Classe B	16,11	12,71
Classe E	16,87	13,30
Classe F	16,50	13,00
Classe G	16,17	12,73
Classe I	19,80	15,21
Classe J	19,80	15,21
Classe L	16,47	12,65
Classe N	16,83	13,28

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 560	(548)
Non réalisé(e) sur les placements	13 227	(6 397)
Total gain net (perte nette)	14 787	(6 945)
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 070	2 511
	16 857	(4 433)
Charges		
Frais de gestion (note 7)	1 025	1 068
Frais d'administration	42	43
Frais de transactions	-	-
	1 067	1 111
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	15 790	(5 544)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	3,60	(1,38)
Classe B	3,50	(1,34)
Classe E	3,70	(1,40)
Classe F	3,61	(1,36)
Classe G	3,52	(1,32)
Classe I	4,76	(1,21)
Classe J	4,72	(1,20)
Classe L	3,98	(1,01)
Classe N	3,69	(1,39)

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	62 166	63 291
Opérations sur les parts		
Parts émises	21 091	23 531
Parts rachetées	(31 893)	(19 112)
	(10 802)	4 419
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	15 790	(5 544)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	67 154	62 166

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	15 790	(5 544)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(14 787)	6 945
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 070)	(2 511)
	(1 067)	(1 110)
Transactions de placements		
Acquisitions	(15 185)	(1 551)
Cessions	14 061	10 805
	(1 124)	9 254
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(7)	(3)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(2 198)	8 141
Financement		
Parts émises	21 091	23 531
Parts rachetées	(31 893)	(19 112)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(10 802)	4 419
Variation nette de la trésorerie	(13 000)	12 560
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	12 870	310
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(130)	12 870
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,01 %)			
Fonds Guardian Equity Income, Série I	3 126 613	<u>53 955</u>	<u>67 162</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,01 %)			<u>(8)</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>67 154</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Guardian Equity Income, Série I</i>	%
Banque Royale du Canada	7,04
Banque Toronto-Dominion	6,84
Banque de Nouvelle-Écosse	5,47
Canadian Natural Resources Ltd	4,52
Banque de Montréal	4,37
TELUS Corp.	4,28
Enbridge Inc.	4,18
TC Energy Corp.	3,55
Brookfield infrastructure Partners Ltd	3,25
Société Financière Manuvie	3,12
Open text Corp.	3,03
Altagas Ltd	2,97
Intact Financial	2,63
Pembina Pipeline	2,57
Nutrien Ltd.	2,38
Guardian Canadian Short-Term Investment Fund	2,35
Restaurant Brands	2,17
Fortis	2,11
Chartwell Retirement REIT	2,07
Magna International Inc.	2,05
Canadian Apartment Properties REIT	1,99
Finning International	1,99
Suncor Energy Inc.	1,98
Element Fleet Management	1,98
H&R Real Estate Investment Trust	1,98

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES DIVIDENDES GUARDIAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	62 161	-	-	62 161
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	62 161	-	-	62 161

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, 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 (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	249 599	248 221
Trésorerie	678	-
Cession de placements à recevoir	-	2 020
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	250 277	250 241
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	704
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	139	127
Total du passif	139	831
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	250 138	249 410
Valeur liquidative, par part		
Classe A	32,80	27,07
Classe B	31,70	26,16
Classe D	31,70	26,16
Classe E	33,35	27,52
Classe F	32,55	26,85
Classe G	31,78	26,22
Classe H	30,80	25,41
Classe I	39,62	31,79
Classe J	39,62	31,79
Classe N	33,33	27,50

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	10 078	(1 075)
Non réalisé(e) sur les placements	17 520	4 155
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	24 336	5 407
Total gain net (perte nette)	51 934	8 487
Intérêts aux fins d'attribution	1	2
Distributions par le fonds sous-jacent	5 248	5 992
	57 183	14 481
Charges		
Frais de gestion (note 7)	1 964	1 711
Frais d'administration	73	63
Frais de transactions	-	-
	2 037	1 774
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	55 146	12 707
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	5,96	0,94
Classe B	5,75	0,91
Classe D	5,68	0,91
Classe E	6,10	0,96
Classe F	5,93	0,94
Classe G	5,78	0,92
Classe H	5,60	0,88
Classe I	8,16	1,89
Classe J	8,09	1,89
Classe N	6,08	0,96

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	249 410	222 003
Opérations sur les parts		
Parts émises	39 703	67 885
Parts rachetées	(94 121)	(53 185)
	(54 418)	14 700
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	55 146	12 707
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	250 138	249 410

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	55 146	12 707
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(27 598)	(3 080)
Distributions par le fonds sous-jacent	(29 584)	(11 399)
	(2 036)	(1 772)
Transactions de placements		
Acquisitions	(5 101)	(29 905)
Cessions	62 925	15 985
	57 824	(13 920)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	12	25
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	55 800	(15 667)
Financement		
Parts émises	39 703	67 885
Parts rachetées	(94 121)	(53 185)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(54 418)	14 700
Variation nette de la trésorerie	1 382	(967)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(704)	263
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	678	(704)
Intérêts reçus	1	2
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,78 %)			
Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser	6 925 627	<u>221 545</u>	<u>249 599</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,22 %)			<u>539</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>250 138</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds d'actions canadiennes Jarislowsky Fraser</i>	%
Fonds d'actions spéciales Jarislowsky Fraser	7,12
Chemins de fer nationaux du Canada	7,10
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	6,77
Banque de Nouvelle-Écosse	6,07
Nutrien Ltd	4,28
Shopify Inc., Catégorie A	4,18
Alimentation Couche-Tard Inc., Catégorie B	3,90
Thomson Reuters Corp.	3,76
WSP Global Inc.	3,75
Open Text Corp.	3,61
Société Financière Manuvie	3,58
Restaurant Brands International Inc.	3,50
CCL Industries Inc., Catégorie B NV	3,41
CGI Group Inc.	3,39
Gildan Activewear Inc.	3,33
Magna International Inc.	3,13
Stantec Inc.	3,00
Groupe SNC-Lavalin Inc.	2,68
Intact Financial Corp.	2,68
Metro Inc., Catégorie A	1,96
Franco Nevada Corp.	1,91
Banque Nationale du Canada	1,89
CAE Inc.	1,87
Kinaxis Inc.	1,64
iA Financial Corp. Inc.	1,59

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES VALEUR JARISLOWSKY FRASER LIMITÉE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)
Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	248 221	-	-	248 221
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	248 221	-	-	248 221

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	292 056	296 547
Trésorerie	19 952	4 765
Cession de placements à recevoir	-	90
Autres débiteurs	710	579
Total de l'actif	312 718	301 981
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	101	86
Total du passif	101	86
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	312 617	301 895
Valeur liquidative, par part		
Classe A	21,67	17,55
Classe B	21,02	17,02
Classe D	20,96	16,97
Classe E	22,03	17,84
Classe F	21,59	17,47
Classe G	21,05	17,03
Classe H	20,36	16,48
Classe I	26,18	20,61
Classe J	26,18	20,61
Classe K	26,18	20,61
Classe L	15,92	12,54
Classe N	22,02	17,83

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	53 913	(3 705)
Non réalisé(e) sur les placements	14 838	22 041
Total gain net (perte nette)	68 751	18 336
Intérêts aux fins d'attribution	(1)	11
Prêts de titres	116	310
Dividendes	7 160	7 174
Écart de conversion sur la trésorerie	(428)	(79)
	75 598	25 752
Charges		
Retenues d'impôts	10	22
Frais de gestion (note 7)	1 258	1 013
Frais d'administration	47	38
Frais de transactions	553	806
	1 868	1 879
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	73 730	23 873
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	4,28	0,93
Classe B	4,15	0,91
Classe D	4,09	0,91
Classe E	4,38	0,95
Classe F	4,29	0,94
Classe G	4,17	0,92
Classe H	4,02	0,88
Classe I	5,87	1,61
Classe J	5,75	1,60
Classe K	5,77	1,61
Classe L	3,62	0,98
Classe N	4,36	0,95

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	301 895	302 679
Opérations sur les parts		
Parts émises	44 608	56 411
Parts rachetées	(107 616)	(81 068)
	(63 008)	(24 657)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	73 730	23 873
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	312 617	301 895

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	73 730	23 873
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	428	79
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(68 751)	(18 333)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	5 407	5 619
Transactions de placements		
Acquisitions	(173 016)	(251 161)
Cessions	246 348	270 777
	73 332	19 616
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(116)	100
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	78 623	25 335
Financement		
Parts émises	44 608	56 411
Parts rachetées	(107 616)	(81 068)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(63 008)	(24 657)
Écart de conversion sur la trésorerie	(428)	(79)
Variation nette de la trésorerie	15 187	599
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	4 765	4 166
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	19 952	4 765
Intérêts reçus	115	321
Dividendes reçus	7 019	7 246

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$		Nombre d'actions	Coût moyen \$	Juste valeur \$
ACTIONS CANADIENNES (89,09 %)				ACTIONS CANADIENNES (89,09 %) (suite)			
Énergie (12,23 %)				Services de communication (2,07 %)			
ARC Resources Ltd	266 600	3 142	3 066	BCE Inc.	50 700	3 133	3 337
Birchcliff Energy Ltd	496 350	1 035	3 206	TELUS Corp.	105 600	2 927	3 146
Cameco Corp.	123 300	3 210	3 401			6 060	6 483
Canadian Natural Resources Ltd	131 850	4 019	7 047	Technologies de l'information (9,88 %)			
Enbridge Inc.	162 800	7 771	8 044	Constellation Software Inc.	2 100	4 242	4 929
Imperial Oil Ltd	71 600	3 178	3 266	Converge Technology Solutions Corp.	425 400	2 652	4 624
MEG Energy Corp.	134 100	1 565	1 569	Nuvei Corp.	64 800	5 265	5 314
Tourmaline Oil Corp.	211 660	3 023	8 644	Shopify Inc., Catégorie A	9 200	2 599	16 024
		26 943	38 243			14 758	30 891
Matériaux de base (9,35 %)				Services (0,79 %)			
Aya Gold & Silver Inc.	209 300	1 978	1 999	Capital Power Corp.	62 500	2 569	2 466
Barrick Gold Corp.	107 300	2 427	2 581	Immobilier (4,30 %)			
Franco-Nevada Corp.	17 600	3 158	3 079	Altus Group Ltd	33 250	1 959	2 360
GoGold Resources Inc.	700 300	2 402	2 122	Dream Industrial REIT UNITS	65 628	1 056	1 130
Ivanhoe Mines Ltd, Classe A	162 700	1 585	1 679	FirstService Corp.	20 400	2 670	5 071
Nutrien Ltd	80 400	5 569	7 644	Fonds de placement immobilier RioCan	152 000	3 184	3 487
Stelco Holdings Inc.	42 308	1 506	1 744	Tricon Capital Group Inc.	71 600	1 266	1 386
Teck Resources Ltd, Catégorie B	180 200	5 355	6 565			10 135	13 434
West Fraser Timber Co. Ltd	15 075	1 569	1 819	TOTAL ACTIONS CANADIENNES		204 066	278 507
		25 549	29 232	ACTIONS AMÉRICAINES (4,33 %)			
Produits industriels (4,64 %)				Produits industriels (0,89 %)			
Boyd Group Service Inc.	7 000	1 664	1 397	Generac Holdings Inc.	6 300	943	2 806
Russel Metals Inc.	41 540	1 503	1 397	Services financiers (1,44 %)			
Stantec Inc.	25 470	1 492	1 810	MSCI Inc.	5 800	1 792	4 498
TFI International Inc.	47 000	2 676	6 668	Technologies de l'information (1,54 %)			
Thomson Reuters Corp.	21 400	2 527	3 237	Microsoft Corp.	11 300	2 468	4 811
		9 862	14 509	Divers (0,46 %)			
Consommation discrétionnaire (2,02 %)				Technologies de l'information (1,54 %)			
Les Vêtements de Sport Gildan Inc.	117 600	5 473	6 307	Invesco Ultra Short Duration ETF	22 525	1 400	1 434
Consommation de base (3,00 %)				TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES			
Loblaw Cos Ltd	79 200	7 510	8 208			6 603	13 549
Premium Brands Holdings Corp.	9 150	1 188	1 157	TOTAL DES PLACEMENTS (93,42 %)			
		8 698	9 365			210 669	292 056
Services financiers (40,81 %)				AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU			
Banque de Montréal	105 200	10 097	14 327	POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (6,58 %)			
Banque de Nouvelle-Écosse	106 700	8 218	9 555				20 561
Banque Nationale du Canada	62 200	4 608	5 999	TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE			
Banque Royale du Canada	175 100	15 714	23 505	COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			
Banque Toronto-Dominion	191 500	15 087	18 572				312 617
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	149 700	10 521	11 436				
Canaccord Genuity Group Inc.	263 650	2 150	3 976				
CIBC	65 150	6 112	9 606				
ECN Capital Corp.	87 962	510	470				
Equitable Group Inc.	40 700	2 580	2 805				
goeasy Ltd	34 200	3 265	6 131				
Intact Corporation financière	9 400	1 253	1 546				
Onex Corp.	47 600	4 362	4 726				
Power Corporation of Canada	149 400	5 960	6 245				
Trisura Group Ltd	181 960	3 582	8 678				
		94 019	127 577				

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES TRIASIMA

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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.

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers.

Risque de crédit

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 31 décembre 2021, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 59 023 \$ (40 206 \$ au 31 décembre 2020) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 60 206 \$ (43 081 \$ au 31 décembre 2020).

De plus, aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 :

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

31 décembre 2020	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	86	-	86

Risque de taux d'intérêt

Aux 31 décembre 2021 et 2020, le Fonds ne détient pas de titres à revenu fixe. Par conséquent, il n'est pas exposé au risque de taux d'intérêt.

Risque de prix

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

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

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

Variation (%)	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
+ 5	13 925	13 327
- 5	(13 925)	(13 327)

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

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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	31 décembre 2021 (%)	31 décembre 2020 (%)
Actions canadiennes		
Énergie	12,23	7,18
Matériaux de base	9,35	17,20
Produits industriels	4,64	12,62
Consommation discrétionnaire	2,02	2,63
Consommation de base	3,00	3,40
Soins de santé	-	0,57
Services financiers	40,81	28,24
Services de communication	2,07	-
Technologies de l'information	9,88	8,28
Services	0,79	6,07
Immobilier	4,30	2,10
Actions américaines		
Produits industriels	0,89	1,83
Consommation de base	-	1,43
Soins de santé	-	2,46
Services financiers	1,44	1,78
Technologies de l'information	1,54	2,44
Divers	0,46	-
Autres éléments d'actif net	6,58	1,77
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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	296 547	-	-	296 547
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	296 547	-	-	296 547

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	12 951	13 842
Trésorerie	36	32
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	12 987	13 874
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	10	12
Total du passif	10	12
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	12 977	13 862
Valeur liquidative, par part		
Classe A	18,73	15,39
Classe B	18,08	14,86
Classe D	18,28	15,02
Classe E	19,04	15,64
Classe F	18,59	15,27
Classe G	18,11	14,87
Classe H	17,59	14,45
Classe I	22,54	18,02
Classe J	22,66	18,11
Classe N	19,02	15,63

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 309	279
Non réalisé(e) sur les placements	1 234	(183)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	-	71
Total gain net (perte nette)	2 543	167
Distributions par le fonds sous-jacent	396	465
	2 939	632
Charges		
Frais de gestion (note 7)	327	303
Frais d'administration	12	11
Frais de transactions	-	-
	339	314
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 600	318
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	3,46	0,26
Classe B	3,34	0,25
Classe D	3,34	0,25
Classe E	3,53	0,26
Classe F	3,45	0,26
Classe G	3,33	0,25
Classe H	3,26	0,24
Classe I	4,71	0,75
Classe J	4,27	0,74
Classe N	3,54	0,26

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	13 862	15 766
Opérations sur les parts		
Parts émises	3 817	2 704
Parts rachetées	(7 302)	(4 926)
	(3 485)	(2 222)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 600	318
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	12 977	13 862

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 600	318
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 543)	(96)
Distributions par le fonds sous-jacent	(396)	(536)
	(339)	(314)
Transactions de placements		
Acquisitions	(1 875)	(570)
Cessions	5 705	3 125
	3 830	2 555
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(2)	4
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	3 489	2 245
Financement		
Parts émises	3 817	2 704
Parts rachetées	(7 302)	(4 926)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(3 485)	(2 222)
Variation nette de la trésorerie	4	23
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	32	9
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	36	32
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,80 %)			
Fonds BlackRock indiciel actions canadiennes, Classe D	241 798	9 488	12 951
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,20 %)			26
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			12 977

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds BlackRock indiciel actions canadiennes, Classe D</i>	%
Shopify Inc., Catégorie A	6,35
Banque Royale du Canada	6,13
Banque Toronto-Dominion	5,67
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	3,58
Banque de Nouvelle-Écosse	3,49
Enbridge Inc.	3,21
Chemins de fer nationaux du Canada	3,03
Banque de Montréal	2,83
Chemin de fer Canadien Pacifique Ltée	2,71
CIBC	2,13
Canadian Natural Resources Ltd	2,02
BCE Inc.	1,92
TC Energy Corp.	1,85
Nutrien Ltd	1,74
Société Financière Manuvie	1,50
Constellation Software Inc.	1,49
Suncor Energy Inc.	1,48
Waste Connections Inc.	1,44
Alimentation Couche-Tard Inc., Catégorie B	1,43
Barrick Gold Corp.	1,37
Financière Sun Life Inc.	1,32
TELUS Corp.	1,30
Franco Nevada Corp.	1,07
Banque Nationale du Canada	1,05
Intact Financial Corp.	0,93

FONDS SSQ INDICE CANADIEN BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	13 842	-	-	13 842
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	13 842	-	-	13 842

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, 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 (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	27 097	19 525
Trésorerie	81	238
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	27 178	19 763
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	100
Autres créditeurs	14	12
Total du passif	14	112
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 164	19 651
Valeur liquidative, par part		
Classe A	27,15	22,19
Classe B	25,94	21,20
Classe E	27,62	22,58
Classe F	26,93	22,00
Classe G	26,22	21,42
Classe I	33,25	26,37
Classe J	33,25	26,37
Classe N	27,58	22,54

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	143	1 231
Non réalisé(e) sur les placements	2 565	(274)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	2 316	2 301
Total gain net (perte nette)	5 024	3 258
Distributions par le fonds sous-jacent	371	158
	5 395	3 416
Charges		
Frais de gestion (note 7)	596	426
Frais d'administration	20	14
Frais de transactions	-	-
	616	440
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 779	2 976
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	4,89	3,11
Classe B	4,67	2,98
Classe E	5,02	3,18
Classe F	4,87	3,11
Classe G	4,74	2,99
Classe I	6,86	4,35
Classe J	6,82	4,30
Classe N	4,98	3,16

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	19 651	17 647
Opérations sur les parts		
Parts émises	9 782	5 197
Parts rachetées	(7 048)	(6 169)
	2 734	(972)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 779	2 976
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	27 164	19 651

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	4 779	2 976
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 708)	(957)
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 687)	(2 459)
	(616)	(440)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 637)	(1 655)
Cessions	360	3 225
	(2 277)	1 570
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2	1
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(2 891)	1 131
Financement		
Parts émises	9 782	5 197
Parts rachetées	(7 048)	(6 169)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	2 734	(972)
Variation nette de la trésorerie	(157)	159
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	238	79
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	81	238
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,75 %)			
Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"	64 509	18 120	27 097
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,25 %)			67
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			27 164

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera Actions canadiennes de petite capitalisation "Core"</i>	%
ATS Automation Tooling Systems Inc.	4,10
Enerplus Corp.	4,01
Aritzia Inc.	3,44
StorageVault Canada Inc.	3,30
Colliers International Group Inc.	3,18
Park Lawn Corp.	3,11
Tamarack Valley Energy Ltd	2,95
Andlauer Healthcare Group Inc.	2,88
Converge Tech Sol	2,78
Summit Industrial Income REIT	2,66
Canadian Western Bank	2,53
Boyd Group Income Fund	2,52
Tricon Residential Inc.	2,51
Goeasy Ltd	2,44
Cargojet Inc.	2,37
equitable Group Inc.	2,34
ERO Copper Corp.	2,19
Richelieu Hardware Ltd	2,14
Tecsys Inc.	2,10
Intertape Polymer Group Inc.	2,03
Premium Brands Holdings Corp.	1,98
Interfor Corp.	1,92
Birchcliff Energy Ltd	1,89
GDI Integrated Facility Serv	1,76
K92 Mining Inc.	1,74

FONDS SSQ ACTIONS CANADIENNES À PETITE CAPITALISATION FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	19 525	-	-	19 525
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	19 525	-	-	19 525

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	92 716	81 831
Trésorerie	186	179
Cession de placements à recevoir	-	1 110
Autres débiteurs	14	31
Total de l'actif	92 916	83 151
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	1 087
Autres créditeurs	43	37
Total du passif	43	1 124
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	92 873	82 027
Valeur liquidative, par part		
Classe A	39,98	30,36
Classe B	38,61	29,31
Classe E	40,66	30,87
Classe F	39,72	30,14
Classe G	38,74	29,41
Classe I	49,15	36,18
Classe J	48,54	35,73
Classe K	55,67	40,98
Classe L	16,67	12,27
Classe N	40,11	30,45

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	15 433	3 141
Non réalisé(e) sur les placements	10 210	2 373
Total gain net (perte nette)	25 643	5 514
Intérêts aux fins d'attribution	(1)	17
Prêts de titres	9	7
Dividendes	738	894
Distributions par le fonds sous-jacent	343	259
Écart de conversion sur la trésorerie	(6)	(53)
	26 726	6 638
Charges		
Retenues d'impôts	85	129
Frais de gestion (note 7)	349	257
Frais d'administration	11	8
Frais de transactions	66	60
	511	454
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	26 215	6 184
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	9,69	1,39
Classe B	9,37	1,34
Classe E	9,97	1,42
Classe F	9,65	1,39
Classe G	9,41	1,34
Classe I	13,17	2,62
Classe J	12,85	2,58
Classe K	14,74	2,98
Classe L	4,43	0,90
Classe N	9,81	1,38

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	82 027	84 684
Opérations sur les parts		
Parts émises	12 969	11 028
Parts rachetées	(28 338)	(19 869)
	(15 369)	(8 841)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	26 215	6 184
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	92 873	82 027

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	26 215	6 184
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
Écart de conversion sur la trésorerie	6	53
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(25 643)	(5 514)
Distributions par le fonds sous-jacent	(343)	(259)
	235	464
Transactions de placements		
Acquisitions	(98 934)	(81 364)
Cessions	114 058	89 377
	15 124	8 013
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	23	26
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	15 382	8 503
Financement		
Parts émises	12 969	11 028
Parts rachetées	(28 338)	(19 869)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(15 369)	(8 841)
Écart de conversion sur la trésorerie	(6)	(53)
Variation nette de la trésorerie	7	(391)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	179	570
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	186	179
Intérêts reçus	8	24
Dividendes reçus	670	786

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (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 (66,68 %)				ACTIONS (66,68 %) (suite)			
ACTIONS AMÉRICAINES (64,33 %)				ACTIONS AMÉRICAINES (64,33 %) (suite)			
Énergie (2,26 %)				Soins de santé (13,53 %) (suite)			
APA Corp.	18 900	485	643	Vertex Pharmaceuticals Inc.	1 600	270	445
EOG Resources Inc.	6 000	522	675			10 872	12 568
Marathon Oil Corp.	37 500	508	779				
		1 515	2 097	Services financiers (7,37 %)			
Matériaux de base (2,82 %)				Affiliated Managers Group Inc.	2 700	580	562
Celanese Corp., Catégorie A	2 800	569	596	CBOE Holdings Inc.	3 600	558	594
CF Industries Holdings Inc.	8 100	532	726	CNA Financial Corp.	10 200	567	569
Olin Corp.	10 200	611	743	Evercore Inc., Catégorie A	3 400	563	585
Westlake Chemical Corp.	4 500	561	553	FactSet Research System Inc.	1 100	570	677
		2 273	2 618	Loews Corp.	7 500	514	548
Produits industriels (3,94 %)				MSCI Inc.	750	540	582
Acuity Brands Inc.	2 400	609	643	Raymond James Financial Inc.	4 900	580	623
Carlisle Cos Inc.	2 100	551	660	SEI Investments Co.	7 000	539	540
Driven Brands Holdings Inc.	14 200	497	604	Tradeweb Markets Inc., Catégorie A	4 700	517	596
Nordson Corp.	1 800	519	582	Upstart Holdings Inc.	1 800	622	345
Robert Half International Inc.	4 200	578	593	W.R. Berkley Corp.	6 000	550	626
Verisk Analytics Inc.	2 000	577	579			6 700	6 847
		3 331	3 661	Services de communication (3,50 %)			
Consommation discrétionnaire (8,15 %)				Activision Blizzard Inc.	4 700	564	396
Airbnb Inc. Catégorie A	2 800	613	590	Alphabet Inc., Catégorie A	200	532	733
AutoNation Inc.	4 100	612	606	Electronic Arts Inc.	3 700	637	618
AutoZone Inc.	300	609	796	Facebook Inc., Catégorie A	1 300	520	553
Boyd Gaming Corp.	6 900	559	573	Playtika Holding Corp.	17 300	606	379
Colombia Sportswear Co.	3 900	519	481	Zynga Inc.	70 500	627	571
Frontdoor Inc.	13 100	595	608			3 486	3 250
Lowe's Cos Inc.	1 900	607	622	Technologies de l'information (22,76 %)			
O'Reilly Automotive Inc.	700	583	626	Adobe Inc.	700	353	502
Penske Automotive Group Inc.	4 500	606	611	Apple Inc.	3 500	76	787
Tempur Sealy International Inc.	10 500	270	625	Applied Materials Inc.	3 800	308	757
Tesla Inc.	550	544	736	Arista Networks Inc.	3 400	593	619
Toll Brothers Inc.	7 600	598	696	Arrow Electronics Inc.	4 000	425	680
		6 715	7 570	Autodesk Inc.	1 600	578	569
Soins de santé (13,53 %)				Broadcom Inc.	700	420	590
Align Technology Inc.	750	493	624	CACI International Inc.	1 800	568	613
AmerisourceBergen Corp.	3 900	595	656	Cadence Design Systems Inc.	3 000	137	708
Anthem Inc.	1 200	572	704	Dropbox Inc., Catégorie A	16 100	498	500
Bio-Techne Corp.	1 000	520	655	EPAM Systems Inc.	800	548	677
Biogen Inc.	1 300	428	395	Fair Isaac Inc.	1 300	639	714
Bristol-Myers Squibb Co.	6 900	588	545	Gartner Inc.	1 800	499	762
Cigna Corp.	2 100	600	610	HP Inc.	15 600	468	744
Danaher Corp.	1 600	456	666	Intel Corp.	7 600	555	495
Edwards Lifesciences Corp.	4 400	561	722	KLA-Tencor Corp.	1 400	533	762
Encompass Health Corp.	6 300	617	520	Lam Research Corp.	700	184	637
Exelixis Inc.	24 600	538	569	Lumentum Holdings Inc.	4 600	524	616
Intuitive Surgical Inc.	1 650	544	750	Manhattan Associates Inc.	3 100	535	610
Mettler-Toledo International	300	466	645	Microsoft Corp.	1 800	307	766
Moderna Inc.	1 600	302	514	Monolithic Power Systems Inc.	1 000	327	624
Molina Healthcare Inc.	1 600	599	644	Motorola Solutions Inc.	2 000	552	688
Pfizer Inc.	10 800	521	807	NVIDIA Corp.	2 000	136	745
Regeneron Pharmaceuticals Inc.	800	565	640	ON Semiconductor Corp.	9 500	440	817
Sage Therapeutics Inc.	6 600	528	355	Oracle Corp.	4 800	341	530
Syneos Health Inc., Catégorie A	4 500	484	585	Paylocity Holdings Corp.	2 000	667	598
Veeva Systems Inc, Catégorie A	1 600	625	517	Qorvo Inc.	2 500	254	495
				SS&C Technologies Holdings	5 900	531	612
				Synopsys Inc.	1 700	420	793
				Texas Instruments Inc.	2 100	443	501
				Ubiquiti Inc.	1 300	315	505
				Universal Display Corp.	2 100	495	439

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, sauf le nombre d'actions et de parts)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
ACTIONS (66,68 %) (suite)			
ACTIONS AMÉRICAINES (64,33 %) (suite)			
Technologies de l'information (22,76 %) (suite)			
Zebra Technologies Corp., Catégorie A	900	471	678
		14 140	21 133
TOTAL ACTIONS AMÉRICAINES		49 032	59 744
ACTIONS INTERNATIONALES (2,35 %)			
Services financiers (0,67 %)			
Arch Capital Group Ltd	11 000	591	619
Technologies de l'information (1,68 %)			
Accenture PLC, Catégorie A	1 600	535	838
Atlassian Corp. PLC, Catégorie A	1 500	397	724
		932	1 562
TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		1 523	2 181
TOTAL ACTIONS		50 555	61 925
	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (33,15 %)			
Hillsdale US Small Cap Equity Fund, Class Z	102 820	19 195	30 791
TOTAL DES PLACEMENTS (99,83 %)		69 750	92 716
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,17 %)			157
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			92 873

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES HILLSDALE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 %).

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers.

Risque de crédit

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 31 décembre 2021, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 18 493 \$ (8 912 \$ au 31 décembre 2020) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 18 863 \$ (9 536 \$ au 31 décembre 2020).

De plus, aux 31 décembre 2021 et 2020 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 :

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

31 décembre 2020	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	1 087	-	1 087
Autres créditeurs	37	-	37

Risque de taux d'intérêt

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 (%)	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
+ 5	4 636	4 092
- 5	(4 636)	(4 092)

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

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 (%)	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
Dollar canadien	+ 5	(4 636)	(4 092)
	- 5	4 636	4 092

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.

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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	31 décembre 2021 (%)	31 décembre 2020 (%)
Actions américaines		
Énergie	2,26	-
Matériaux de base	2,82	1,26
Produits industriels	3,94	6,78
Consommation discrétionnaire	8,15	6,03
Consommation de base	-	2,05
Soins de santé	13,53	12,93
Services financiers	7,37	8,58
Services de communication	3,50	1,34
Technologies de l'information	22,76	23,75
Actions internationales		
Produits industriels	-	0,67
Consommation discrétionnaire	-	0,63
Soins de santé	-	1,39
Services financiers	0,67	1,41
Technologies de l'information	1,68	0,58
Fonds de placement		
Actions américaines	33,15	32,36
Autres éléments d'actif net	0,17	0,24
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 :

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

31 décembre 2020				
Actifs financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	55 286	-	-	55 286
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	26 545	-	-	26 545
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	81 831	-	-	81 831

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	33 791	29 766
Trésorerie	264	-
Cession de placements à recevoir	-	390
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	34 055	30 156
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	332
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	15	16
Total du passif	15	348
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	34 040	29 808
Valeur liquidative, par part		
Classe A	17,31	15,63
Classe B	16,71	15,09
Classe E	17,61	15,89
Classe F	17,20	15,52
Classe G	16,77	15,13
Classe I	21,12	18,51
Classe J	21,12	18,51
Classe N	17,58	15,87

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	508	1 218
Non réalisé(e) sur les placements	(530)	(1 827)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	3 669	1 758
Total gain net (perte nette)	3 647	1 149
Intérêts aux fins d'attribution	1	-
Distributions par le fonds sous-jacent	538	1 283
	4 186	2 432
Charges		
Frais de gestion (note 7)	904	902
Frais d'administration	32	32
Frais de transactions	-	-
	936	934
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 250	1 498
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,68	0,66
Classe B	1,62	0,63
Classe E	1,72	0,67
Classe F	1,68	0,66
Classe G	1,63	0,64
Classe I	2,64	1,27
Classe J	2,63	1,27
Classe N	1,71	0,67

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	29 808	37 219
Opérations sur les parts		
Parts émises	10 983	4 312
Parts rachetées	(10 001)	(13 221)
	982	(8 909)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 250	1 498
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	34 040	29 808

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 250	1 498
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	22	609
Distributions par le fonds sous-jacent	(4 207)	(3 041)
	(935)	(934)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 800)	-
Cessions	3 350	9 475
	550	9 475
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1)	(1)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(386)	8 540
Financement		
Parts émises	10 983	4 312
Parts rachetées	(10 001)	(13 221)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	982	(8 909)
Variation nette de la trésorerie	596	(369)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(332)	37
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	264	(332)
Intérêts reçus	1	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,27 %)			
Fonds d'actions américaines Beutel Goodman, Classe I	1 901 474	31 048	33 791
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,73 %)			249
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			34 040

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds d'actions américaines Beutel Goodman, Classe I</i>	%
Omnicom Group Inc.	5,26
Kimberly-Clark Corp.	5,26
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	5,20
Amgen Inc.	5,15
Merck & Co. Inc.	5,14
Amdocs Ltd	4,91
Kellogg Co.	4,78
Ameriprise Financial Inc.	4,48
Campbell Soup Co.	4,44
Nortonlifelock Inc.	4,41
eBay Inc.	4,40
Verizon Communications Inc.	4,36
Harley-Davidson Inc.	4,06
AmerisourceBergen Corp.	3,65
Polaris Industries Inc.	3,42
Biogen Inc.	3,36
Millerknoll Inc.	3,15
Flowserve Corp.	2,94
American Express Co.	2,71
SEI Investments Co.	2,70
Comcast Corp., Catégorie A	2,61
Gentex Corp.	2,30
Interpublic Group of Companies Inc.	2,09
Cummins Inc.	2,00
Ingersoll-Rand PLC, Catégorie A	1,90

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES BEUTEL GOODMAN

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent d'actions américaines Beutel Goodman, Classe I. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	29 766	-	-	29 766
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	29 766	-	-	29 766

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	154 035	104 318
Trésorerie	1 051	1 109
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	155 086	105 427
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	915	1 110
Autres créditeurs	80	56
Total du passif	995	1 166
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	154 091	104 261
Valeur liquidative, par part		
Classe A	24,09	18,66
Classe B	23,27	18,04
Classe D	23,45	18,18
Classe E	24,48	18,97
Classe F	23,93	18,53
Classe G	23,33	18,08
Classe H	22,61	17,52
Classe I	29,28	22,04
Classe J	29,29	22,05
Classe N	24,46	18,96

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	1 524	2 801
Non réalisé(e) sur les placements	34 510	11 759
Total gain net (perte nette)	36 034	14 560
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	1 238	991
	37 272	15 552
Charges		
Frais de gestion (note 7)	3 402	2 287
Frais d'administration	122	81
Frais de transactions	-	-
	3 524	2 368
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	33 748	13 184
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	5,46	2,54
Classe B	5,27	2,45
Classe D	5,23	2,46
Classe E	5,58	2,60
Classe F	5,47	2,55
Classe G	5,30	2,47
Classe H	5,12	2,39
Classe I	7,37	3,51
Classe J	7,18	3,54
Classe N	5,57	2,57

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	104 261	78 095
Opérations sur les parts		
Parts émises	46 886	49 874
Parts rachetées	(30 804)	(36 892)
	16 082	12 982
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	33 748	13 184
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	154 091	104 261

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	33 748	13 184
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(36 034)	(14 560)
Distributions par le fonds sous-jacent	(1 238)	(991)
	(3 524)	(2 367)
Transactions de placements		
Acquisitions	(16 095)	(20 380)
Cessions	3 455	10 820
	(12 640)	(9 560)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	24	27
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(16 140)	(11 900)
Financement		
Parts émises	46 886	49 874
Parts rachetées	(30 804)	(36 892)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	16 082	12 982
Variation nette de la trésorerie	(58)	1 082
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	1 109	27
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	1 051	1 109
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,96 %)			
Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie A	6 187 453	<u>80 903</u>	<u>154 035</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,04 %)			<u>56</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>154 091</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie A</i>	%
Microsoft Corp.	9,59
Alphabet Inc., Catégorie A	7,55
Moody's Corp.	6,79
UnitedHealth Group Inc.	5,33
AutoZone Inc.	4,83
The Sherwin-Williams Co.	4,39
Johnson & Johnson	4,31
MasterCard Inc., Catégorie A	4,24
PepsiCo Inc.	4,22
MSCI Inc.	3,97
Lowe's Cos Inc.	3,94
Linde PLC	3,40
NIKE Inc., Catégorie B	3,10
The TJX Cos Inc.	3,06
Oracle Corp.	2,79
Mettler-Toledo International Inc.	2,78
Analog Devices Inc.	2,68
Graco Inc.	2,64
Middleby Corp.	2,62
Carrier Global Corp.	2,62
Becton Dickinson and Co.	2,59
CME Group Inc., Catégorie A	2,54
Otis Worldwide Corp.	2,42
Factset Research Systems Inc.	2,38
Colgate-Palmolive Co.	1,97

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera Actions américaines, Catégorie A. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	104 318	-	-	104 318
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	104 318	-	-	104 318

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, 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 (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	31 237	23 812
Trésorerie	29	133
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	1	-
Total de l'actif	31 267	23 945
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	14	14
Total du passif	14	14
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	31 253	23 931
Valeur liquidative, par part		
Classe A	23,30	17,96
Classe B	22,74	17,53
Classe E	23,57	18,16
Classe F	23,20	17,86
Classe G	22,90	17,64
Classe I	27,41	20,51
Classe J	27,41	20,51
Classe N	23,52	18,13

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	2 255	686
Non réalisé(e) sur les placements	5 951	3 953
Total gain net (perte nette)	8 206	4 639
Distributions par le fonds sous-jacent	334	211
	8 540	4 850
Charges		
Frais de gestion (note 7)	650	434
Frais d'administration	23	15
Frais de transactions	-	-
	673	449
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	7 867	4 401
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	5,34	3,39
Classe B	5,26	3,28
Classe E	5,42	3,42
Classe F	5,33	3,36
Classe G	5,26	3,34
Classe I	6,86	4,37
Classe J	6,88	4,32
Classe N	5,38	3,41

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	23 931	14 489
Opérations sur les parts		
Parts émises	11 770	13 936
Parts rachetées	(12 315)	(8 895)
	(545)	5 041
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	7 867	4 401
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	31 253	23 931

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	7 867	4 401
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(8 206)	(4 639)
Distributions par le fonds sous-jacent	(334)	(211)
	(673)	(449)
Transactions de placements		
Acquisitions	(4 555)	(8 190)
Cessions	5 670	3 690
	1 115	(4 500)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(1)	6
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	441	(4 943)
Financement		
Parts émises	11 770	13 936
Parts rachetées	(12 315)	(8 895)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(545)	5 041
Variation nette de la trésorerie	(104)	98
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	133	35
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	29	133
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,95 %)			
Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie C	1 308 272	18 371	31 237
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,05 %)			16
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			31 253

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera Actions américaines, Catégorie C</i>	%
Microsoft Corp.	9,59
Alphabet Inc., Catégorie A	7,55
Moody's Corp.	6,79
UnitedHealth Group Inc.	5,33
AutoZone Inc.	4,83
The Sherwin-Williams Co.	4,39
Johnson & Johnson	4,31
MasterCard Inc., Catégorie A	4,24
PepsiCo Inc.	4,22
MSCI Inc.	3,97
Lowe's Cos Inc.	3,94
Linde PLC	3,40
NIKE Inc., Catégorie B	3,10
The TJX Cos Inc.	3,06
Oracle Corp.	2,79
Mettler-Toledo International Inc.	2,78
Analog Devices Inc.	2,68
Graco Inc.	2,64
Middleby Corp	2,62
Carrier Global Corp.	2,62
Becton Dickinson and Co.	2,59
CME Group Inc., Catégorie A	2,54
Otis Worldwide Corp.	2,42
Factset Research Systems Inc.	2,38
Colgate-Palmolive Co.	1,97

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES COUVERTES SUR LA DEVISE FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera Actions américaines, Catégorie C. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	23 812	-	-	23 812
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	23 812	-	-	23 812

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	71 986	57 255
Trésorerie	-	15
Cession de placements à recevoir	275	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	72 261	57 270
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	211	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	31	30
Total du passif	242	30
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	72 019	57 240
Valeur liquidative, par part		
Classe A	23,84	19,27
Classe B	23,02	18,60
Classe D	23,24	18,77
Classe E	24,28	19,61
Classe F	23,77	19,19
Classe G	23,14	18,69
Classe H	22,39	18,09
Classe I	28,90	22,69
Classe J	29,23	22,95
Classe N	24,22	19,57

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	3 768	2 635
Non réalisé(e) sur les placements	10 992	2 245
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	-	2 011
Total gain net (perte nette)	14 760	6 891
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	866	856
	15 626	7 748
Charges		
Frais de gestion (note 7)	1 511	1 269
Frais d'administration	55	47
Frais de transactions	-	-
	1 566	1 316
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 060	6 432
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	4,58	2,02
Classe B	4,41	1,96
Classe D	4,41	1,98
Classe E	4,67	2,08
Classe F	4,57	2,04
Classe G	4,43	1,97
Classe H	4,29	1,90
Classe I	6,23	2,94
Classe J	6,28	2,98
Classe N	4,66	2,06

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	57 240	53 821
Opérations sur les parts		
Parts émises	21 937	19 808
Parts rachetées	(21 218)	(22 821)
	719	(3 013)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 060	6 432
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	72 019	57 240

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 060	6 432
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(14 760)	(4 880)
Distributions par le fonds sous-jacent	(866)	(2 867)
	(1 566)	(1 315)
Transactions de placements		
Acquisitions	(8 405)	(4 685)
Cessions	9 025	9 000
	620	4 315
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1	1
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(945)	3 001
Financement		
Parts émises	21 937	19 808
Parts rachetées	(21 218)	(22 821)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	719	(3 013)
Variation nette de la trésorerie	(226)	(12)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	15	27
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(211)	15
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,95 %)			
Fonds BlackRock CAD indiciel actions ÉU, Classe D	1 698 880	<u>39 915</u>	<u>71 986</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,05 %)			<u>33</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>72 019</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds BlackRock CAD indiciel actions ÉU, Classe D</i>	%
Apple Inc.	6,83
Microsoft Corp.	6,23
Amazon.com Inc.	3,59
Alphabet Inc., Catégorie A	2,15
Tesla Inc.	2,12
Alphabet Inc., Catégorie C	2,00
Meta Platforms Inc. Catégorie A	1,96
NVIDIA Corp.	1,82
Berkshire Hathaway Inc., Catégorie B	1,35
UnitedHealth Group Inc.	1,17
JPMorgan Chase & Co.	1,16
Johnson & Johnson	1,11
Home Depot Inc.	1,08
The Procter & Gamble Co.	0,98
Visa Inc., Catégorie A	0,90
Pfizer Inc.	0,82
Bank of America Corp.	0,79
MasterCard Inc., Catégorie A	0,77
Walt Disney	0,70
Broadcom Inc.	0,68
Adobe Inc.	0,67
Cisco Systems Inc.	0,66
Netflix Inc.	0,66
Thermo Fisher Scientific Inc.	0,65
Accenture PLC, Catégorie A	0,65

FONDS SSQ INDICE AMÉRICAIN BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	57 255	-	-	57 255
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	57 255	-	-	57 255

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

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

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL

Exercice terminé le 31 décembre

2021

	\$
Revenus	
Gain net (perte nette)	
Réalisé(e) à la cession des placements	3
Non réalisé(e) sur les placements	976
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	96
Total gain net (perte nette)	1 075
Distributions par le fonds sous-jacent	22
	1 097
Charges	
Frais de gestion (note 7)	5
Frais d'administration	-
Frais de transactions	-
	5
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 092
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part	
Classe A	0,74
Classe B	0,74
Classe E	0,74
Classe F	0,74
Classe G	0,74
Classe I	1,11
Classe J	1,08
Classe N	0,74

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercice terminé le 31 décembre	2021
	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	-
Opérations sur les parts	
Parts émises	10 707
Parts rachetées	(125)
	10 582
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 092
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	11 674

ÉTAT DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercice terminé le 31 décembre	2021
	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:	
Opérationnelles	
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 092
Éléments sans incidence sur la trésorerie	
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(979)
Distributions par le fonds sous-jacent	(118)
	(5)
Transactions de placements	
Acquisitions	(10 635)
Cessions	75
	(10 560)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	7
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(10 558)
Financement	
Parts émises	10 707
Parts rachetées	(125)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	10 582
Variation nette de la trésorerie	24
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	24
Intérêts reçus	-
Dividendes reçus	-

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen \$	Juste valeur \$
PLACEMENTS (99,85 %)			
Fisher Investments US Small Cap Core Equity ESG Unit Trust Fund	1 061 005	10 681	11 657
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,15 %)			17
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			11 674

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fisher Investments US Small Cap Core Equity ESG Unit Trust Fund</i>	%
West Pharmaceutical Services Inc.	3,93
SVB Financial Group	3,84
Pool Corporation	3,66
Align Technology Inc.	3,54
Charles River Laboratories Inc.	3,39
Paycom software Inc.	3,16
Omniceil Inc.	2,92
Freshpet Inc.	2,60
Dominos Pizza Inc.	2,59
Builders FirstSource Inc.	2,50
Medpace Holdings Inc.	2,45
Fair Isaac Corp.	2,37
Darling Ingredients Inc.	2,30
Pegasystems Inc.	2,21
Cleveland-Cliffs Inc.	2,12
CONMED Corp.	2,03
Qorvo Inc.	1,76
Cactus Inc., Catégorie A	1,74
PerkinElmer Inc.	1,72
Stifel Financial Corp.	1,70
Marvell Technology Inc.	1,66
Revolve Group Inc., Catégorie A	1,66
WillScot Mobile Mini Holdings Corp.	1,65
MKS Instruments Inc.	1,58
Halozyme Therapeutics Inc.	1,57

FONDS SSQ ACTIONS AMÉRICAINES À PETITE CAPITALISATION ESG FISHER

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fisher Investments US Small Cap Core Equity ESG Unit Trust. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par Fisher Investments selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion descendante et un style de gestion majoritairement croissance.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

Au cours de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	24 552	14 368
Trésorerie	61	2
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	24 613	14 370
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	9	7
Total du passif	9	7
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	24 604	14 363
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,27	-
Classe B	10,27	-
Classe E	10,27	-
Classe F	10,27	-
Classe G	10,27	-
Classe I	10,46	-
Classe J	11,36	10,06
Classe N	10,27	-

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	44	-
Non réalisé(e) sur les placements	2 003	163
Total gain net (perte nette)	2 047	163
Distributions par le fonds sous-jacent	557	-
	2 604	163
Charges		
Frais de gestion (note 7)	7	-
Frais d'administration	-	-
Frais de transactions	-	-
	7	-
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 597	163
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	0,93	-
Classe B	0,93	-
Classe E	0,93	-
Classe F	0,93	-
Classe G	0,93	-
Classe I	1,29	-
Classe J	1,37	1,37
Classe N	0,90	-

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	14 363	-
Opérations sur les parts		
Parts émises	8 904	14 235
Parts rachetées	(1 260)	(35)
	7 644	14 200
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 597	163
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	24 604	14 363

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	2 597	163
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(2 047)	(163)
Distributions par le fonds sous-jacent	(557)	-
	(7)	-
Transactions de placements		
Acquisitions	(8 100)	(14 220)
Cessions	520	15
	(7 580)	(14 205)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	2	7
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(7 585)	(14 198)
Financement		
Parts émises	8 904	14 235
Parts rachetées	(1 260)	(35)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	7 644	14 200
Variation nette de la trésorerie	59	2
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	2	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	61	2
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,79 %)			
Fonds GQG Partners Actions internationales de qualité, Classe I	2 216 247	22 386	24 552
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,21 %)			52
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			24 604

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds GQG Partners Actions internationales de qualité, Classe I</i>	%
AstraZeneca PLC	5,83
Novo Nordisk A/S, Catégorie B	4,46
ASML Holding NV	3,98
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	3,39
Petróleo Brasileiro SA	3,25
BNP Paribas SA	3,23
Philip Morris International Inc.	2,72
Visa Inc., Catégorie A	2,49
Glencore PLC	2,45
HDFC Bank Ltd	2,31
Exxon Mobil Corp.	2,29
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	2,13
ICICI Bank Ltd	2,07
Alphabet Inc., Catégorie A	2,03
Alphabet Inc., Catégorie C	2,02
Genmab A/S	1,99
Accenture PLC, Catégorie A	1,98
Roche Holding AG	1,90
Schneider Electric SE	1,88
Banque Royale du Canada	1,86
Credit Agricole SA	1,69
Daimler AG	1,63
Essilorluxottica	1,59
Unilever PLC	1,57
Nestlé SA	1,57

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES GQG PARTNERS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent GQG Partners Actions internationales de qualité, Classe I. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par GQG Partners LLC selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante, axée sur la sélection de titres et l'investissement à long terme.

Juste valeur des instruments financiers

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

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

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	14 368	-	-	14 368
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	14 368	-	-	14 368

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	226 399	194 965
Trésorerie	4 785	2 273
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	31	51
Total de l'actif	231 215	197 289
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	109	96
Total du passif	109	96
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	231 106	197 193
Valeur liquidative, par part		
Classe A	19,72	18,67
Classe B	18,96	17,94
Classe D	11,01	10,42
Classe E	20,06	18,98
Classe F	19,56	18,50
Classe G	19,09	18,06
Classe H	11,01	10,42
Classe I	24,65	22,56
Classe J	24,65	22,56
Classe K	24,65	22,56
Classe L	16,37	14,98
Classe N	20,01	18,94

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	6 786	5 378
Non réalisé(e) sur les placements	9 117	28 472
Total gain net (perte nette)	15 903	33 850
Intérêts aux fins d'attribution	(1)	7
Prêts de titres	14	2
Dividendes	3 530	3 153
	19 446	37 012
Charges		
Retenues d'impôts	363	118
Frais de gestion (note 7)	896	585
Frais d'administration	28	18
Frais de transactions	128	44
	1 415	765
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	18 031	36 247
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,05	3,06
Classe B	1,00	2,95
Classe D	0,58	1,92
Classe E	1,07	3,12
Classe F	1,04	3,05
Classe G	1,02	2,98
Classe H	0,58	1,92
Classe I	2,08	4,32
Classe J	2,08	4,30
Classe K	2,08	4,30
Classe L	1,38	2,87
Classe N	1,06	3,11

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	197 193	164 715
Opérations sur les parts		
Parts émises	55 342	36 249
Parts rachetées	(39 460)	(40 018)
	15 882	(3 769)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	18 031	36 247
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	231 106	197 193

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	18 031	36 247
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(15 903)	(33 850)
Distributions par le fonds sous-jacent	-	-
	2 128	2 397
Transactions de placements		
Acquisitions	(56 978)	(31 195)
Cessions	41 447	32 643
	(15 531)	1 448
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	33	8
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(13 370)	3 853
Financement		
Parts émises	55 342	36 249
Parts rachetées	(39 460)	(40 018)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	15 882	(3 769)
Variation nette de la trésorerie	2 512	84
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	2 273	2 189
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	4 785	2 273
Intérêts reçus	13	9
Dividendes reçus	3 187	3 017

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, sauf le nombre d'actions)

	Nombre d'actions	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
ACTIONS INTERNATIONALES (97,96 %)			
Produits industriels (21,51 %)			
Assa Abloy AB, Catégorie B	196 808	7 107	7 616
Atlas Copco AB, Catégorie A	82 661	4 079	7 248
Daikin Industries Ltd	32 300	6 058	9 270
Ferguson PLC	52 212	4 413	11 809
Siemens AG	43 427	7 204	9 575
Vinci SA	31 075	3 756	4 181
		<u>32 617</u>	<u>49 699</u>
Consommation discrétionnaire (8,75 %)			
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	8 208	6 639	8 642
Sony Corp.	72 700	4 877	11 576
		<u>11 516</u>	<u>20 218</u>
Consommation de base (13,80 %)			
Kerry Group PLC, Catégorie A	41 027	6 131	6 729
Nestlé SA	48 601	4 657	8 599
Swedish Match AB	1 029 307	6 982	10 387
Unilever PLC	90 748	6 604	6 184
		<u>24 374</u>	<u>31 899</u>
Soins de santé (13,29 %)			
AstraZeneca PLC	49 490	6 455	7 412
Hoya Corp.	57 900	5 147	10 897
Novo Nordisk A/S, Catégorie B	87 122	4 663	12 407
		<u>16 265</u>	<u>30 716</u>
Services financiers (14,06 %)			
AIA Group Ltd	486 200	4 917	6 206
Bank Central Asia Tbk PT	8 868 900	5 049	5 762
Deutsche Boerse AG	26 641	5 793	5 656
HDFC Bank Ltd	180 524	8 518	14 872
		<u>24 277</u>	<u>32 496</u>
Technologies de l'information (20,26 %)			
ASML Holding NV	14 038	5 009	14 367
Keyence Corp.	9 500	2 758	7 553
Samsung Electronics Co. Ltd	3 978	6 052	8 303
SAP SE	43 829	6 113	7 892
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	57 248	3 211	8 718
		<u>23 143</u>	<u>46 833</u>
Services (4,36 %)			
Iberdrola SA	253 825	4 345	3 827
SSE PLC	219 775	5 260	6 255
		<u>9 605</u>	<u>10 082</u>
Immobilier (1,93 %)			
Deutsche Annington Immobilien SE	63 605	5 134	4 456
TOTAL ACTIONS INTERNATIONALES		<u>146 931</u>	<u>226 399</u>
TOTAL DES PLACEMENTS (97,96 %)		<u>146 931</u>	<u>226 399</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (2,04 %)			<u>4 707</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u>231 106</u>

FONDS SSQ ACTIONS INTERNATIONALES C WORLDWIDE

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Objectif du Fonds

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

Stratégie de placement

Le Fonds est investi principalement dans des actions de sociétés internationales de grande capitalisation situées à l'extérieur de l'Amérique du Nord. Le Fonds peut détenir des parts de fonds correspondant aux titres précités.

La stratégie d'investissement du gestionnaire externe, C WorldWide Asset Management, est de favoriser une approche de gestion ascendante, axée sur la sélection de titres et l'investissement à long terme. Il utilise un style de gestion croissance à prix raisonnable. Il privilégie des entreprises ayant un fort pouvoir de fixation des prix et qui profitent de l'évolution de tendances économiques mondiales.

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers.

Risque de crédit

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 31 décembre 2021, des titres en portefeuille ayant une juste valeur de 5 224\$ (0 \$ au 31 décembre 2020) étaient prêtés. Le montant des garanties détenues relativement aux opérations de prêts de titres s'élevaient à 5 329 \$ (0 \$ au 31 décembre 2020).

De plus, aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 :

31 décembre 2021	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	109	-	109

31 décembre 2020	Moins de 1 mois (\$)	De 1 à 3 mois (\$)	Total (\$)
Achat de placements à payer	-	-	-
Autres crédateurs	96	-	96

Risque de taux d'intérêt

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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 (%)	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
+ 5	11 320	9 748
- 5	(11 320)	(9 748)

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 (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
Couronne danoise	12 407	7 198
Couronne suédoise	25 251	14 409
Dollar américain	31 891	36 156
Dollar de Hong Kong	6 206	12 397
Euro	71 510	64 020
Franc suisse	8 599	6 747
Livre sterling	25 477	12 851
Roupie indonésienne	5 762	5 043
Yen japonais	39 296	36 144
Total	226 399	194 965

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 (%)	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
Dollar canadien	+ 5	(11 320)	(9 748)
	- 5	11 320	9 748

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.

Aux 31 décembre 2021 et 2020, 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	31 décembre 2021 (%)	31 décembre 2020 (%)
Actions internationales		
Produits industriels	21,51	16,24
Consommation discrétionnaire	8,75	7,35
Consommation de base	13,80	16,85
Soins de santé	13,29	11,85
Services financiers	14,06	20,27
Technologies de l'information	20,26	21,50
Services	4,36	2,71
Immobilier	1,93	2,10
Autres éléments d'actif net	2,04	1,13
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 :

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	226 399	-	-	226 399
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	226 399	-	-	226 399

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	194 965	-	-	194 965
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	-	-	-	-
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	194 965	-	-	194 965

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	19 200	88 176
Trésorerie	1 794	-
Cession de placements à recevoir	35	1 190
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	21 029	89 366
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	1 081
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	1 740	23
Total du passif	1 740	1 104
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	19 289	88 262
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,21	14,22
Classe B	14,63	13,68
Classe D	14,77	13,81
Classe E	15,48	14,46
Classe F	15,07	14,08
Classe G	14,68	13,72
Classe H	14,26	13,33
Classe I	18,76	16,99
Classe J	18,76	16,99
Classe N	15,45	14,44

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	11 843	708
Non réalisé(e) sur les placements	(8 037)	2 743
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	278	941
Total gain net (perte nette)	4 084	4 392
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 220	1 838
	6 304	6 231
Charges		
Frais de gestion (note 7)	255	260
Frais d'administration	9	9
Frais de transactions	-	-
	264	269
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 040	5 962
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,20	0,71
Classe B	1,16	0,68
Classe D	1,16	0,68
Classe E	1,23	0,72
Classe F	1,19	0,70
Classe G	1,16	0,68
Classe H	1,13	0,66
Classe I	2,04	1,30
Classe J	2,00	1,31
Classe N	1,22	0,73

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	88 262	63 335
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 594	36 591
Parts rachetées	(81 607)	(17 626)
	(75 013)	18 965
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 040	5 962
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	19 289	88 262

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	6 040	5 962
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(3 806)	(3 451)
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 498)	(2 779)
	(264)	(268)
Transactions de placements		
Acquisitions	(6 360)	(35 410)
Cessions	82 795	16 105
	76 435	(19 305)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1 717	7
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	77 888	(19 566)
Financement		
Parts émises	6 594	36 591
Parts rachetées	(81 607)	(17 626)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(75 013)	18 965
Variation nette de la trésorerie	2 875	(601)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(1 081)	(480)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	1 794	(1 081)
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,54 %)			
Fonds BlackRock CAD indiciel actions MSCI EAEO, Classe D	797 615	<u>16 086</u>	<u>19 200</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,46 %)			<u>89</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>19 289</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds BlackRock CAD indiciel actions MSCI EAEO, Classe D</i>	%
Nestlé SA	2,20
ASML Holding NV	1,90
Roche Holding AG	1,63
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	1,32
Toyota Motor Corp.	1,08
Novartis AG	1,08
Novo Nordisk A/S, Catégorie B	1,06
AstraZeneca PLC	1,04
Sony Corp.	0,89
SAP SE	0,83
Unilever PLC	0,80
Commonwealth Bank of Australia	0,75
Siemens AG	0,74
Diageo PLC	0,73
Total SA	0,73
HSBC Holdings PLC	0,71
AIA Group Ltd	0,70
Keyence Corp.	0,68
L'Oreal SA	0,68
Sanofi	0,66
GlaxoSmithKline PLC	0,63
Schneider Electric SE	0,61
CSL Ltd	0,58
Allianz SE	0,54
BP PLC	0,52

FONDS SSQ INDICE INTERNATIONAL BLACKROCK

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	19 200	-	-	19 200
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	19 200	-	-	19 200

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	88 176	-	-	88 176
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	88 176	-	-	88 176

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	29 386	26 203
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	145	205
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	29 531	26 408
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	56	39
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	11	11
Total du passif	67	50
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	29 464	26 358
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,30	13,45
Classe B	14,66	12,87
Classe E	15,56	13,68
Classe F	15,25	13,40
Classe G	14,82	13,02
Classe I	19,00	16,17
Classe J	19,00	16,17
Classe L	15,49	13,18
Classe N	15,53	13,66

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	(85)	(1 038)
Non réalisé(e) sur les placements	993	(1 369)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	2 579	-
Total gain net (perte nette)	3 487	(2 407)
Distributions par le fonds sous-jacent	996	999
	4 483	(1 408)
Charges		
Frais de gestion (note 7)	475	514
Frais d'administration	15	17
Frais de transactions	-	-
	490	531
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 993	(1 939)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,81	(1,01)
Classe B	1,75	(0,96)
Classe E	1,85	(1,03)
Classe F	1,82	(0,99)
Classe G	1,76	(0,97)
Classe I	2,80	(0,70)
Classe J	2,79	(0,70)
Classe L	2,28	(0,57)
Classe N	1,84	(1,03)

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	26 358	35 668
Opérations sur les parts		
Parts émises	6 268	6 528
Parts rachetées	(7 155)	(13 899)
	(887)	(7 371)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 993	(1 939)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	29 464	26 358

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	3 993	(1 939)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(908)	2 407
Distributions par le fonds sous-jacent	(3 575)	(999)
	(490)	(531)
Transactions de placements		
Acquisitions	(2 580)	(1 965)
Cessions	3 940	9 450
	1 360	7 485
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	-	(3)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	870	6 951
Financement		
Parts émises	6 268	6 528
Parts rachetées	(7 155)	(13 899)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(887)	(7 371)
Variation nette de la trésorerie	(17)	(420)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(39)	381
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(56)	(39)
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,74 %)			
FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD	2 199 251	<u>29 639</u>	<u>29 386</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,26 %)			<u>78</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>29 464</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>FGC mondial à revenu pour actionnaires Émeraude TD</i>	%
Broadcom Inc.	2,25
AbbVie Inc.	2,11
Microsoft Corp.	2,04
Cisco Systems Inc.	2,04
Intl Business Machines Corp.	1,91
Nutrien Ltd	1,88
Total Energies SE	1,85
Analog Devices Inc.	1,73
AstraZeneca PLC	1,69
Iron Mountain Inc.	1,58
Banque Royale du Canada	1,56
Allianz SE	1,53
Restaurant Brands International Inc.	1,50
Metlife Inc.	1,48
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	1,45
Samsung Electronics Co. Ltd	1,43
Deutsche telekom AG-REG	1,42
Sanofi	1,41
Novartis AG	1,40
AXA SA	1,37
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG	1,36
Apple Inc.	1,35
Philip Morris International Inc.	1,30
Emerson Electric Co.	1,29
KLA-Tencor Corp.	1,23

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES DIVIDENDES TD

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	29 386	-	-	29 386
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	29 386	-	-	29 386

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	26 203	-	-	26 203
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	26 203	-	-	26 203

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	284 064	205 778
Trésorerie	327	-
Cession de placements à recevoir	1 040	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	285 431	205 778
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	281
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	1 889	119
Total du passif	1 889	400
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	283 542	205 378
Valeur liquidative, par part		
Classe A	21,57	17,74
Classe B	20,85	17,14
Classe D	12,57	10,34
Classe E	21,87	17,99
Classe F	21,54	17,69
Classe G	21,04	17,30
Classe H	12,57	10,34
Classe I	26,61	21,12
Classe J	26,71	21,20
Classe L	18,70	14,84
Classe N	21,86	17,98

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	10 705	6 439
Non réalisé(e) sur les placements	47 374	22 068
Total gain net (perte nette)	58 079	28 507
Intérêts aux fins d'attribution	-	2
Distributions par le fonds sous-jacent	2 702	1 823
	60 781	30 332
Charges		
Frais de gestion (note 7)	2 661	1 533
Frais d'administration	78	45
Frais de transactions	-	-
	2 739	1 578
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	58 042	28 754
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	3,88	2,14
Classe B	3,74	2,09
Classe D	2,25	1,32
Classe E	3,94	2,17
Classe F	3,89	2,14
Classe G	3,78	2,08
Classe H	2,28	1,32
Classe I	5,64	3,14
Classe J	5,55	3,15
Classe L	3,91	2,27
Classe N	3,94	2,16

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	205 378	177 181
Opérations sur les parts		
Parts émises	131 631	80 875
Parts rachetées	(111 509)	(81 432)
	20 122	(557)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	58 042	28 754
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	283 542	205 378

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	58 042	28 754
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(58 079)	(28 507)
Distributions par le fonds sous-jacent	(2 702)	(1 823)
	(2 739)	(1 576)
Transactions de placements		
Acquisitions	(54 610)	(38 280)
Cessions	36 065	40 160
	(18 545)	1 880
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1 770	42
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(19 514)	346
Financement		
Parts émises	131 631	80 875
Parts rachetées	(111 509)	(81 432)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	20 122	(557)
Variation nette de la trésorerie	608	(211)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(281)	(70)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	327	(281)
Intérêts reçus	-	2
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,18 %)			
Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A	7 217 705	184 096	284 064
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,18 %)			(522)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			283 542

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Fiera Actions mondiales, Catégorie A</i>	%
Moody's Corp.	6,73
Alphabet Inc., Catégorie A	6,68
Microsoft Corp.	6,17
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	4,66
MasterCard Inc., Catégorie A	4,09
Keyence Corp.	3,82
The Sherwin-Williams Co.	3,82
AutoZone Inc.	3,81
Nestlé SA	3,60
Johnson & Johnson	3,50
MSCI Inc.	3,37
Diageo PLC	3,16
Roche Holding AG	3,16
PepsiCo Inc.	3,00
UnitedHealth Group Inc.	2,87
The TJX Cos Inc.	2,77
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	2,74
NIKE Inc., Catégorie B	2,66
Oracle Corp.	2,61
Mettler-Toledo International Inc.	2,51
CME Group Inc., Catégorie A	2,47
Becton Dickinson and Co.	2,46
Carrier Global Corp.	2,40
Otis Worldwide Corp.	2,35
Geberit	2,09

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES FIERA CAPITAL

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fiera Actions mondiales, Catégorie A. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 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 :

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	284 064	-	-	284 064
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	284 064	-	-	284 064

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	205 778	-	-	205 778
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	205 778	-	-	205 778

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE		
Aux	31 décembre 2021	31 décembre 2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	7 590	6 668
Trésorerie	270	6
Cession de placements à recevoir	-	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	7 860	6 674
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	-
Achat de placements à payer	275	-
Autres créditeurs	5	4
Total du passif	280	4
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	7 580	6 670
Valeur liquidative, par part		
Classe A	10,68	-
Classe B	10,68	-
Classe E	10,68	-
Classe F	10,68	-
Classe G	10,68	-
Classe I	10,88	-
Classe J	11,17	9,59
Classe N	10,72	9,53

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	481	-
Non réalisé(e) sur les placements	558	(138)
Total gain net (perte nette)	1 039	(138)
Distributions par le fonds sous-jacent	128	1
	1 167	(137)
Charges		
Frais de gestion (note 7)	13	1
Frais d'administration	-	-
Frais de transactions	-	-
	13	1
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 154	(138)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,25	-
Classe B	1,26	-
Classe E	1,21	-
Classe F	1,26	-
Classe G	1,26	-
Classe I	1,61	-
Classe J	1,60	(1,16)
Classe N	1,22	(1,50)

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	6 670	-
Opérations sur les parts		
Parts émises	5 344	6 916
Parts rachetées	(5 588)	(108)
	(244)	6 808
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 154	(138)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	7 580	6 670

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	1 154	(138)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 039)	138
Distributions par le fonds sous-jacent	(128)	(1)
	(13)	(1)
Transactions de placements		
Acquisitions	(4 730)	(6 805)
Cessions	5 250	-
	520	(6 805)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1	4
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	508	(6 802)
Financement		
Parts émises	5 344	6 916
Parts rachetées	(5 588)	(108)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(244)	6 808
Variation nette de la trésorerie	264	6
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	6	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	270	6
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,13 %)			
Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I	695 116	7 170	7 590
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,13 %)			(10)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			7 580

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I</i>	%
Alphabet Inc., Catégorie C	6,89
UnitedHealth Group Inc.	5,26
Microsoft Corp.	4,39
Wal-Mart Inc.	4,13
Visa Inc., Catégorie A	4,05
Charter Communications Inc., Catégorie A	3,45
The Procter & Gamble Co.	3,17
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	3,11
Exxon Mobil Corp.	2,96
Target Corp.	2,86
Novo Nordisk A/S, Catégorie B	2,78
Petróleo Brasileiro SA	2,58
AstraZeneca PLC	2,56
Philip Morris International Inc.	2,36
AstraZeneca PLC Spons ADR	2,35
Occidental Petroleum Corp.	2,16
Johnson & Johnson	2,12
JPMorgan Chase & Co.	2,12
BNP Paribas SA	2,02
KKR & Co. Inc	1,92
Devon Energy Corp.	1,82
British American Tobacco PLC	1,72
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	1,71
Glencore PLC	1,69
Humana Inc.	1,58

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES GQG PARTNERS

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales GQG Partners est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent GQG Partners actions mondiales de qualité, Classe I. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales GQG Partners se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par GQG Partners LLC selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion ascendante, axée sur la sélection de titres et l'investissement à long terme.

Juste valeur des instruments financiers

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

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	7 590	-	-	7 590
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	7 590	-	-	7 590

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	6 668	-	-	6 668
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	6 668	-	-	6 668

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre 2021	31 décembre 2020
Aux	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	115 457	90 782
Trésorerie	79	-
Cession de placements à recevoir	-	1 140
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	115 536	91 922
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	-	997
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	77	67
Total du passif	77	1 064
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	115 459	90 858
Valeur liquidative, par part		
Classe A	15,21	13,51
Classe B	15,21	13,51
Classe E	15,23	13,52
Classe F	15,24	13,53
Classe G	15,22	13,52
Classe I	16,58	14,24
Classe J	16,58	14,24
Classe N	15,21	13,51

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	4 102	1 464
Non réalisé(e) sur les placements	(5 989)	16 226
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	14 051	3 462
Total gain net (perte nette)	12 164	21 152
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 694	434
	14 858	21 587
Charges		
Frais de gestion (note 7)	694	428
Frais d'administration	21	13
Frais de transactions	-	-
	715	441
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 143	21 146
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	1,63	2,78
Classe B	1,62	2,78
Classe E	1,64	2,80
Classe F	1,64	2,79
Classe G	1,63	2,78
Classe I	2,28	3,34
Classe J	2,28	3,28
Classe N	1,63	2,79

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	90 858	71 691
Opérations sur les parts		
Parts émises	43 450	18 328
Parts rachetées	(32 992)	(20 307)
	10 458	(1 979)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 143	21 146
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	115 459	90 858

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	14 143	21 146
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	1 887	(17 690)
Distributions par le fonds sous-jacent	(16 745)	(3 896)
	(715)	(440)
Transactions de placements		
Acquisitions	(25 527)	(6 725)
Cessions	16 850	7 950
	(8 677)	1 225
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	10	21
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(9 382)	806
Financement		
Parts émises	43 450	18 328
Parts rachetées	(32 992)	(20 307)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	10 458	(1 979)
Variation nette de la trésorerie	1 076	(1 173)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(997)	176
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	79	(997)
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,00 %)			
Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust	4 250 554	100 078	115 457
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (0,00 %)			2
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			115 459

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust</i>	%
Ashtead Group PLC	4,02
HubSpot Inc.	3,84
Align Technology Inc.	3,69
SVB Financial Group	3,31
Dominos Pizza Inc.	3,16
Sartorius AG	2,68
Charles River Laboratories Inc.	2,59
Fair Isaac Corp.	2,57
Bechtle AG	2,50
ON Semiconductor Corp.	2,46
MKS Instruments Inc.	2,32
Medpace Holdings Inc.	2,22
OZ Minerals LTD	1,94
Qorvo Inc.	1,93
Paycom Software Inc.	1,81
Halozyme Therapeutics Inc.	1,75
Kingspan Group PLC	1,63
Lumentum Holdings Inc.	1,60
DR Horton Inc.	1,42
Paylocity Holdings Corp.	1,41
Disco Corp. NPV	1,41
First Republic Bank	1,33
MINEBEA MITSUMI Inc.	1,28
Nibe Industrier AB	1,24
IPG Photonics Corp.	1,24

FONDS SSQ ACTIONS MONDIALES À PETITE CAPITALISATION FISHER

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Fisher est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent Fisher Investments Global Small Cap Equity Unit Trust. Par conséquent, le Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Fisher se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré activement par Fisher Investments selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion descendante et un style de gestion majoritairement croissance.

Juste valeur des instruments financiers

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

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	115 457	-	-	115 457
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	115 457	-	-	115 457

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	90 782	-	-	90 782
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	90 782	-	-	90 782

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	86 484	100 122
Trésorerie	-	-
Cession de placements à recevoir	-	435
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	86 484	100 557
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	148	764
Achat de placements à payer	-	-
Autres créditeurs	55	69
Total du passif	203	833
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	86 281	99 724
Valeur liquidative, par part		
Classe A	13,95	16,32
Classe B	13,14	15,38
Classe E	14,20	16,61
Classe F	13,85	16,18
Classe G	13,46	15,75
Classe I	18,01	20,26
Classe J	17,77	20,00
Classe L	12,80	14,41
Classe N	13,97	16,35

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	4 048	1 936
Non réalisé(e) sur les placements	(21 688)	17 812
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	4 215	1 080
Total gain net (perte nette)	(13 425)	20 828
Intérêts aux fins d'attribution	-	1
Distributions par le fonds sous-jacent	2 192	2 199
	(11 233)	23 028
Charges		
Frais de gestion (note 7)	477	273
Frais d'administration	13	7
Frais de transactions	-	-
	490	280
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(11 723)	22 748
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	(2,44)	3,22
Classe B	(2,33)	3,05
Classe E	(2,48)	3,30
Classe F	(2,40)	3,25
Classe G	(2,35)	3,12
Classe I	(2,33)	4,65
Classe J	(2,28)	4,50
Classe L	(1,58)	3,71
Classe N	(2,43)	3,23

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	99 724	78 688
Opérations sur les parts		
Parts émises	30 867	22 367
Parts rachetées	(32 587)	(24 079)
	(1 720)	(1 712)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(11 723)	22 748
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	86 281	99 724

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	(11 723)	22 748
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	17 640	(19 748)
Distributions par le fonds sous-jacent	(6 407)	(3 279)
	(490)	(279)
Transactions de placements		
Acquisitions	(15 800)	(9 155)
Cessions	18 640	10 575
	2 840	1 420
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	(14)	22
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	2 336	1 163
Financement		
Parts émises	30 867	22 367
Parts rachetées	(32 587)	(24 079)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	(1 720)	(1 712)
Variation nette de la trésorerie	616	(549)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	(764)	(215)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(148)	(764)
Intérêts reçus	-	1
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,24 %)			
Fisher Investments Emerging Markets Equity Unit Trust Fund	6 662 171	<u>83 486</u>	<u>86 484</u>
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,24 %)			<u>(203)</u>
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			<u><u>86 281</u></u>

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fisher Investments Emerging Markets Equity Unit Trust Fund</i>	%
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co. Ltd	10,71
Samsung Electronics Co. Ltd	7,66
Tencent Holdings Ltd	6,76
NAVER Corp.	4,62
Alibaba Group Holding Ltd	3,75
MediaTek Inc.	3,42
Mercadolibre Inc.	3,39
JD.com Inc	3,11
Vale SA	3,05
Petroleo Brasileiro SA	2,84
Samsung Biologics Co. Ltd	2,74
WuXi Biologics Inc.	2,69
HDFC Bank Ltd	2,51
SK Hynix Inc.	2,40
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	2,39
Meituan, Catégorie B	2,39
Tata Consultancy Services Ltd	2,24
Yandex NV	2,08
Southern Copper Corp.	1,95
Pinduoduo Inc.	1,65
ASE Technology Holding Co. Ltd	1,59
Genscript Biotech Corp.	1,53
Lukoil PJSC	1,47
Kakao Corp.	1,35
Bank Mandiri Persero Tbk PT	1,27

FONDS SSQ ACTIONS MARCHÉS ÉMERGENTS FISHER

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	86 484	-	-	86 484
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	86 484	-	-	86 484

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	100 122	-	-	100 122
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	100 122	-	-	100 122

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DE LA SITUATION FINANCIÈRE	31 décembre	31 décembre
Aux	2021	2020
	\$	\$
Actif		
Actif courant		
Placements	119 652	79 921
Trésorerie	-	949
Cession de placements à recevoir	1 590	-
Autres débiteurs	-	-
Total de l'actif	121 242	80 870
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire	643	-
Achat de placements à payer	-	760
Autres créditeurs	1 379	27
Total du passif	2 022	787
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	119 220	80 083
Valeur liquidative, par part		
Classe A	18,10	15,53
Classe B	17,69	15,15
Classe E	18,44	15,81
Classe F	17,97	15,39
Classe I	22,74	18,84
Classe J	22,73	18,83
Classe L	13,60	11,27
Classe N	18,38	15,77

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTATS DU RÉSULTAT GLOBAL		
Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Revenus		
Gain net (perte nette)		
Réalisé(e) à la cession des placements	212	(2 898)
Non réalisé(e) sur les placements	6 386	(6 552)
Distribué(e) par le fonds sous-jacent	6 924	359
Total gain net (perte nette)	13 522	(9 091)
Distributions par le fonds sous-jacent	5 077	2 115
	18 599	(6 976)
Charges		
Frais de gestion (note 7)	974	1 019
Frais d'administration	30	31
Frais de transactions	-	-
	1 004	1 050
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	17 595	(8 026)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part		
Classe A	2,57	(1,82)
Classe B	2,53	(1,75)
Classe E	2,63	(1,83)
Classe F	2,57	(1,78)
Classe I	3,89	(1,54)
Classe J	3,91	(1,54)
Classe L	2,32	(0,92)
Classe N	2,62	(1,85)

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	80 083	96 740
Opérations sur les parts		
Parts émises	42 925	23 019
Parts rachetées	(21 383)	(31 650)
	21 542	(8 631)
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	17 595	(8 026)
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	119 220	80 083

ÉTATS DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercices terminés les 31 décembre	2021	2020
	\$	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:		
Opérationnelles		
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	17 595	(8 026)
Éléments sans incidence sur la trésorerie		
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(6 598)	9 450
Distributions par le fonds sous-jacent	(12 001)	(2 474)
	(1 004)	(1 050)
Transactions de placements		
Acquisitions	(28 257)	(7 655)
Cessions	4 775	18 875
	(23 482)	11 220
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	1 352	(15)
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(23 134)	10 155
Financement		
Parts émises	42 925	23 019
Parts rachetées	(21 383)	(31 650)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	21 542	(8 631)
Variation nette de la trésorerie	(1 592)	1 524
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	949	(575)
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(643)	949
Intérêts reçus	-	-
Dividendes reçus	-	-

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

TABLEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (100,36 %)			
Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)	3 690 586	119 131	119 652
AUTRES ÉLÉMENTS D'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (-0,36 %)			(432)
TOTAL DE L'ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS (100,00 %)			119 220

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds Lazard Global Listed Infrastructure (Canada)</i>	%
National Grid PLC	8,66
Vinci SA	8,27
Ferrovial SA	8,20
Snam SpA	7,78
Terna SpA	6,32
Atlantia SpA	5,47
Pinnacle West Capital Corp.	4,84
United Utilities Group PLC	4,70
Severn Trent PLC	3,96
CSX Corp.	3,90
Consolidated Edison Inc.	3,39
Transurban Group	2,78
Italgas SpA	2,54
Atlas Arteria Ltd	2,46
Hera SpA	2,44
Power Assets Holdings Ltd	2,42
Norfolk Southern Corp.	2,15
Ameren Corp.	1,95
Flughafen Zurich AG	1,90
SES SA	1,73
Eutelsat Communications SA	1,67
CK Infrastructure Holdings Ltd	1,33
NorthWestern Corp.	1,23
Redes Energeticas Nacionas SGPS SA	0,73
Pennon Group PLC	0,65

FONDS SSQ INFRASTRUCTURES MONDIALES LAZARD

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (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 9 et 10 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 :

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	119 652	-	-	119 652
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	119 652	-	-	119 652

31 décembre 2020				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	79 921	-	-	79 921
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	79 921	-	-	79 921

Au cours des exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTAT DE LA SITUATION FINANCIÈRE		31 décembre
Au		2021
		\$
Actif		
Actif courant		
Placements		6 757
Trésorerie		-
Cession de placements à recevoir		790
Autres débiteurs		-
Total de l'actif		7 547
Passif		
Passif courant		
Découvert bancaire		93
Achat de placements à payer		-
Autres créditeurs		695
Total du passif		788
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs		6 759
Valeur liquidative, par part		
Classe A		11,34
Classe B		11,34
Classe E		11,34
Classe F		11,35
Classe I		11,56
Classe J		11,56
Classe L		11,56
Classe N		11,34

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS (audités)

(en milliers de dollars, à l'exception des données par part)

ÉTAT DU RÉSULTAT GLOBAL	
Exercice terminé le 31 décembre	2021
	\$
Revenus	
Gain net (perte nette)	
Réalisé(e) à la cession des placements	123
Non réalisé(e) sur les placements	933
Total gain net (perte nette)	1 056
Distributions par le fonds sous-jacent	26
	1 082
Charges	
Frais de gestion (note 7)	85
Frais d'administration	3
Frais de transactions	-
	88
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	994
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part	
Classe A	1,31
Classe B	1,31
Classe E	1,31
Classe F	1,32
Classe I	1,53
Classe J	1,52
Classe L	1,53
Classe N	1,31

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

ÉTATS FINANCIERS (audités)
(en milliers de dollars)

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

Exercice terminé le 31 décembre	2021
	\$
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs au début de l'exercice	-
Opérations sur les parts	
Parts émises	8 377
Parts rachetées	(2 612)
	5 765
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	994
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs à la fin de l'exercice	6 759

ÉTAT DES FLUX DE TRÉSORERIE

Exercice terminé le 31 décembre	2021
	\$
Flux de trésorerie liés aux activités suivantes:	
Opérationnelles	
Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs	994
Éléments sans incidence sur la trésorerie	
(Gain net) perte nette réalisé(e) et non réalisé(e) sur les placements	(1 056)
Distributions par le fonds sous-jacent	(26)
	(88)
Transactions de placements	
Acquisitions	(7 735)
Cessions	1 270
	(6 465)
Variation des autres éléments d'actif et de passif d'opération	695
Flux de trésorerie liés aux activités opérationnelles	(5 858)
Financement	
Parts émises	8 377
Parts rachetées	(2 612)
Flux de trésorerie liés aux activités de financement	5 765
Variation nette de la trésorerie	(93)
Trésorerie (découvert bancaire) au début de l'exercice	-
Trésorerie (découvert bancaire) à la fin de l'exercice	(93)
Intérêts reçus	-
Dividendes reçus	-

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

TABEAU DES TITRES EN PORTEFEUILLE (audité)

Au 31 décembre 2021 (en milliers, à l'exception du nombre de parts)

	Nombre de parts	Coût moyen	Juste valeur
		\$	\$
PLACEMENTS (99,97 %)			
Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I	305 642	5 824	6 757
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 %)			6 759

PRINCIPAUX TITRES DU FONDS SOUS-JACENT (non audités)

<i>Fonds d'immobilier mondial CI, Catégorie I</i>	%
Prologis Inc.	5,44
Tricon Residential Inc.	5,43
American Homes 4 Rent, Catégorie, A	4,80
Alexandria Real Estate Equities Inc.	4,47
ESR Cayman Ltd	3,64
Camden Property Trust	3,32
InterRent Real Estate Investment Trust	3,17
Granite Real Estate Investment Trust	3,06
American Tower Corp.	2,93
Equinix Inc.	2,68
AvalonBay Communities Inc.	2,63
Americold Realty Trust	2,57
Invitation Homes Inc.	2,37
First Industrial Realty Trust Inc.	2,33
Equity LifeStyle Properties Inc.	2,33
Duke Realty Corp.	2,28
Switch Inc., Catégorie A	2,22
Chartwell Retirement Residences	2,19
Minto Apartment Real Estate Investment Trust	1,91
Brookfield Asset Management Inc., Catégorie A	1,89
Extra Space Storage Inc.	1,89
Apartment Income Reit Corp.	1,81
Allied Properties Real Estate Investment Trust	1,81
First Capital Real Estate Investment Trust	1,80
Kilroy Realty Corp.	1,78

FONDS SSQ IMMOBILIER MONDIAL CI

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS SPÉCIFIQUES AU FONDS (audités)

Exercice terminé le 31 décembre 2021 (en milliers de dollars)

Nature et ampleur des risques découlant des instruments financiers

Le Fonds SSQ Immobilier mondial CI est un fonds distinct qui investit exclusivement dans le fonds sous-jacent d'immobilier mondial CI, Catégorie I. Par conséquent, le Fonds SSQ Immobilier mondial CI se définit comme étant un fonds de fonds. À cet effet, veuillez vous référer aux notes 9 et 10 pour obtenir de l'information sur les risques relatifs aux instruments financiers. Le fonds sous-jacent est géré par Gestion mondiale d'actifs CI selon une méthode de gestion qui lui est propre, pour laquelle la stratégie d'investissement est de favoriser une approche de gestion combinée ascendante et descendante.

Juste valeur des instruments financiers

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

31 décembre 2021				
Instruments financiers	Niveau 1 (\$)	Niveau 2 (\$)	Niveau 3 (\$)	Total (\$)
Obligations	-	-	-	-
Actions	-	-	-	-
Fonds négociés en Bourse	-	-	-	-
Fonds de placement	6 757	-	-	6 757
Instruments financiers dérivés	-	-	-	-
Marché monétaire	-	-	-	-
Total	6 757	-	-	6 757

Au cours de l'exercice terminé le 31 décembre 2021, il n'y a eu aucun transfert d'instruments financiers entre les niveaux 1 et 2.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES

Les Fonds SSQ (ci-après « Fonds ») sont des fonds distincts à capital variable constitués en vertu de la *Loi sur les assurances* du Québec et administrés par SSQ, Société d'assurance-vie inc. (ci-après la « Société »). Le siège social de la Société est situé au 2525, boulevard Laurier, Québec (Québec), Canada. L'actif net des Fonds est la propriété de la Société et est comptabilisé séparément de ses autres actifs. Les Fonds ne sont pas des entités juridiques distinctes de la Société.

La publication des états financiers des Fonds a été approuvée par le conseil d'administration de la Société le 25 février 2022.

Au 31 décembre 2021, les Fonds présents sont :

Fonds	Gestionnaires	Début des activités
Marché monétaire Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	1 ^{er} décembre 1997
Obligations court terme Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	25 septembre 2008
Obligations Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	16 juin 2009
Obligations PIMCO	PIMCO Canada	27 mai 2008
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe	AlphaFixe Capital	15 juin 2018
Obligations mondiales PIMCO	PIMCO Canada	13 janvier 2014
Obligations de sociétés CI Signature	Gestion mondiale d'actifs CI	21 novembre 2016
Indice obligataire BlackRock	BlackRock Asset Management	4 juillet 2005
Portefeuille bêta intelligent plus – sécuritaire	Multiples (page 43)	14 juin 2019
Portefeuille bêta intelligent plus – équilibré	Multiples (page 48)	14 juin 2019
Portefeuille bêta intelligent plus – croissance	Multiples (page 53)	14 juin 2019
Portefeuille bêta intelligent plus – audacieux	Multiples (page 58)	14 juin 2019
Stratégie sécuritaire	Multiples (page 64)	7 décembre 1998
Stratégie équilibrée	Multiples (page 69)	1 ^{er} décembre 1997
Stratégie croissance	Multiples (page 74)	7 décembre 1998
Stratégie audacieuse	Multiples (page 79)	14 novembre 2005
Stratégie 100 % actions	Multiples (page 84)	21 juin 2021
Celestia sécuritaire	Multiples (page 89)	22 septembre 2008
Celestia équilibré	Multiples (page 94)	22 septembre 2008
Celestia croissance	Multiples (page 99)	22 septembre 2008
Celestia audacieux	Multiples (page 104)	22 septembre 2008
Celestia 100 % actions	Multiples (page 109)	21 juin 2021
Revenu sécuritaire Guardian	Guardian Capital LP	12 juin 2015
Revenu Guardian	Guardian Capital LP	12 juin 2015
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge	Gestion mondiale d'actifs CI	9 juin 2014
Revenu et croissance mondial CI Signature	Gestion mondiale d'actifs CI	9 juin 2014
Actions canadiennes dividendes Guardian	Guardian Capital LP	1 ^{er} juin 2012
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée	Jarislowsky Fraser Limitée	1 ^{er} novembre 2001
Actions canadiennes Triasima	Triasima Inc. Gestion de portefeuille	2 octobre 2006
Indice canadien BlackRock	BlackRock Asset Management	7 décembre 1998
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	1 ^{er} novembre 2001
Actions américaines Hillsdale	Hillsdale Investment Management	30 avril 2012
Actions américaines Beutel Goodman	Beutel Goodman	9 novembre 2015
Actions américaines Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	9 novembre 2015
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	21 novembre 2016
Indice américain BlackRock	BlackRock Asset Management	7 décembre 1998
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher	Fisher Investments	28 janvier 2021
Actions internationales GQG Partners	GQG Partners LLC	1 ^{er} octobre 2020
Actions internationales C WorldWide	C WorldWide Asset Management	9 juin 2008
Indice international BlackRock	BlackRock Asset Management	4 juillet 2005
Actions mondiales dividendes TD	Gestion de Placements TD	13 janvier 2014
Actions mondiales Fiera Capital	Corporation Fiera Capital	31 mars 2016
Actions mondiales GQG Partners	GQG Partners LLC	1 ^{er} octobre 2020

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES (suite)

Fonds	Gestionnaires	Début des activités
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher	Fisher Investments	14 juin 2019
Actions marchés émergents Fisher	Fisher Investments	21 juillet 2011
Infrastructures mondiales Lazard	Lazard Asset Management	12 juin 2007
Immobilier mondial CI	Gestion mondiale d'actifs CI	21 juin 2021

Chacun des Fonds a été scindé en différentes classes de Fonds ayant chacune leur propre valeur unitaire et leur propre frais de gestion. Les différentes classes de Fonds offertes sont les suivantes :

Classes	Produits
A	Unité de FPG garantie option de base 75/100 offerte avant le 26 novembre 2012
B	Unité de FPG garantie option supérieur 100/100 offerte avant le 26 novembre 2012
C	Revenu garanti SSQ offert avant le 3 mai 2013
D	CIG Boursier offert avant le 26 novembre 2012
E	Unité de FPG garantie régulière 75/75 offerte depuis le 26 novembre 2012
F	Unité de FPG garantie enrichie 75/100 offerte depuis le 26 novembre 2012
G	Unité de FPG garantie optimale 100/100 offerte depuis le 26 novembre 2012
H	CIG Boursier offert depuis le 26 novembre 2012
I	Gestion privée (investissement de 500 000\$ et plus)
J	Clientèle institutionnelle
K	Interfonds
L	Clientèle institutionnelle spécialisée
N	Fonds collectifs

Modification à l'offre de Fonds

Depuis le 21 juin 2021, les Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners, SSQ Actions mondiales GQG Partners et SSQ Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher sont offerts à la clientèle visée par la notice explicative. Auparavant, ces Fonds n'étaient offerts qu'à la clientèle institutionnelle.

Fermeture de Fonds

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
Immobilier mondial Morgan Stanley	Immobilier mondial CI	21 juin 2021
Actions internationales Hexavest	Actions internationales C WorldWide	14 décembre 2020
Actions mondiales couvertes sur les devises Hexavest	Actions mondiales Fiera Capital	14 décembre 2020
Actions mondiales tous pays Hexavest	Actions mondiales Fiera Capital	14 décembre 2020

Participation dans les Fonds

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

Fonds	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
Obligations PIMCO	197	335
Obligations mondiales PIMCO	1 433	93
Stratégie sécuritaire	4 911	5 174
Stratégie équilibrée	26 458	21 283
Stratégie croissance	18 362	16 517
Stratégie audacieuse	8 592	6 995
Revenu sécuritaire Guardian	524	507
Revenu Guardian	570	511
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge	4 389	4 275
Revenu et croissance mondial CI Signature	25 489	20 924
Actions Canadiennes Triasima	281	-
Actions canadiennes dividendes Guardian	3 752	1 928

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

1. INFORMATIONS GÉNÉRALES (suite)

Participation dans les Fonds (suite)

Fonds	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
Actions américaines Hillsdale	2 162	1 610
Actions internationales C WorldWide	1 688	1 174
Actions mondiales dividendes TD	5 409	4 636
Actions mondiales Fiera Capital	4 545	2 528
Actions marchés émergents Fisher	327	28
Infrastructures mondiales Lazard	3 165	2 837
Immobilier mondial CI	905	-

De plus, aux 31 décembre 2021 et 2020, les régimes de retraite offerts aux employés de la Société détenaient des parts des Fonds.

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES

Mode de présentation

Les présents états financiers sont préparés conformément aux Normes internationales d'information financière (« IFRS ») en vigueur au 31 décembre 2021, telles que publiées par l'*International Accounting Standards Board* (« IASB ») et énoncées dans le Manuel de CPA Canada – Comptabilité.

Utilisation de jugements de la direction

La préparation d'états financiers conformément aux IFRS exige que la direction ait recours à son jugement pour établir des estimations et des hypothèses qui ont une incidence sur les montants de l'actif et du passif comptabilisés à la date des états financiers ainsi que sur les montants comptabilisés à titre de produits et de charges au cours de l'exercice. Les résultats réels pourraient différer des résultats estimatifs.

La direction a établi que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement selon IFRS 10 « États financiers consolidés » puisqu'ils :

- Obtiennent des fonds d'un ou de plusieurs investisseurs afin de leur fournir des services de gestion d'investissement.
- Déclarent à leurs investisseurs qu'ils ont pour objet d'investir les fonds dans le seul but de réaliser des rendements sous forme de plus-value en capital et/ou de revenus d'investissement.
- Évaluent et apprécient la performance de la quasi-totalité de leurs investissements sur la base de la juste valeur.

Le jugement le plus important posé par la direction pour déterminer que les Fonds répondent à la définition d'une entité d'investissement est que la quasi-totalité de leurs placements sont évalués et appréciés à la juste valeur.

Pour classer et évaluer les instruments financiers détenus par les Fonds, la direction est tenue de poser des jugements importants aux termes d'IFRS 9 « Instruments financiers ». La direction a procédé à l'évaluation du modèle économique des Fonds qui veut que la quasi-totalité des actifs et passifs financiers est détenue afin d'être transigée. La direction a établi que la comptabilisation à la juste valeur par le biais du résultat net correspond à la présentation et l'évaluation la plus adéquate pour ces actifs et passifs financiers.

Devises étrangères

Les états financiers des Fonds sont présentés en dollars canadiens, ce qui correspond à la devise fonctionnelle des Fonds.

Certains placements et autres éléments d'actif et de passif sont libellés en devises. Ceux-ci sont convertis dans la devise fonctionnelle au taux de change en vigueur à chaque date d'évaluation incluant à la date de clôture de l'exercice. Les achats et les ventes de placements ainsi que les produits et les charges sont convertis au taux de change en vigueur aux dates respectives des transactions. Les gains ou les pertes de change réalisés et non réalisés sont comptabilisés dans l'état du résultat global, respectivement dans les postes « Gain net (perte nette) réalisé(e) à la cession des placements » et « Gain net (perte nette) non réalisé(e) sur les placements ». Les écarts de conversion se rapportant à la trésorerie sont présentés sous le poste « Écart de conversion sur la trésorerie ».

Instruments financiers – Classement et comptabilisation

Lors de la comptabilisation initiale des instruments financiers, les Fonds comptabilisent ceux-ci à la juste valeur, majorée des coûts de transactions dans le cas des instruments financiers évalués au coût amorti. L'évaluation ultérieure des instruments financiers dépend de leur classement. Les Fonds classent les actifs financiers dans l'une des catégories suivantes : à la juste valeur par le biais du résultat net ou au coût amorti. Les Fonds classent les passifs financiers dans l'une des catégories suivantes : à la juste valeur par le biais du résultat net ou au coût amorti.

Les instruments financiers sont classés en fonction de la nature et de l'utilisation par les Fonds de l'instrument financier au moment de sa comptabilisation initiale.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (audités)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES (suite)

Placements

Les placements incluent des actions, des titres négociés en Bourse, des obligations, des fonds de placement ainsi que du marché monétaire. Les placements des Fonds sont classés à la juste valeur par le biais du résultat net, puisque l'objectif visé n'est pas la collection de flux de trésorerie contractuels, ni la collection de flux de trésorerie contractuels et la vente.

Les opérations de placement sont comptabilisées à la date de transaction et le coût des placements est établi selon la méthode du coût moyen.

Instruments financiers dérivés

Les instruments financiers dérivés comprennent des contrats de change standardisés. Ces instruments financiers sont évalués à la juste valeur par le biais du résultat net, étant donné qu'ils sont détenus à des fins de transaction.

La juste valeur d'un contrat à terme représente le prix qui serait reçu pour la vente d'un actif ou payé pour le transfert d'un passif lors d'une transaction normale entre des intervenants du marché à la date d'évaluation. La juste valeur de ces contrats est comptabilisée sous le poste « Juste valeur des instruments financiers dérivés » à l'actif à l'état de la situation financière. Les instruments financiers dérivés ayant une juste valeur négative sont présentés au passif à l'état de la situation financière.

Parts des Fonds détenues par les souscripteurs

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

Trésorerie et découvert bancaire

La trésorerie et le découvert bancaire représentent les comptes bancaires. Ils sont évalués au coût amorti.

Autres éléments d'actif et de passif

Les autres éléments d'actif incluent les cessions de placements à recevoir ainsi que les autres débiteurs alors que les autres éléments de passif incluent les achats de placements à payer ainsi que les autres créiteurs. Ces autres éléments d'actif et de passif sont évalués au coût amorti.

Instruments financiers – Dépréciation d'actifs financiers

Les Fonds doivent comptabiliser une correction de valeur pour pertes au titre des pertes de crédit attendues sur leurs actifs financiers évalués au coût amorti. Les Fonds ont déterminé que les montants ne sont pas significatifs, donc aucune perte de crédit n'a été comptabilisée au cours de l'exercice.

Prêts de titres

Certains Fonds peuvent recourir aux prêts de titres dans le but de gagner des revenus additionnels. Certains titres sont prêtés à d'autres établissements pour une courte période. Les Fonds reçoivent des garanties, qui représentent au minimum 102 % de la juste valeur des titres prêtés. Ces garanties sont déposées par l'emprunteur auprès d'un dépositaire de titres et y sont conservées jusqu'à ce que les titres prêtés aient été remis aux Fonds. Les garanties des titres prêtés sont constituées de bons du Trésor, d'obligations du Canada ou d'une province canadienne. Afin d'assurer que la juste valeur des titres donnés en garantie est supérieure à 102 %, la juste valeur des titres prêtés fait l'objet d'un suivi quotidien. Les titres prêtés continuent d'être présentés dans le tableau des titres en portefeuille ainsi que dans l'état de la situation financière du Fonds.

Les revenus provenant de prêts de titres sont présentés sous le poste « Prêts de titres » à l'état du résultat global. La valeur des titres prêtés et de la garantie reçue par les Fonds effectuant des opérations de prêts de titres est présentée dans les notes spécifiques de chacun de ces Fonds.

Comptabilisation des revenus

Les revenus de placements sont comptabilisés sur base d'exercice.

Les gains et les pertes réalisés à la cession de placements ainsi que les gains et les pertes non réalisés sur les placements sont calculés en fonction du coût moyen des placements et, le cas échéant, excluent les frais de transactions imputés aux résultats dès qu'ils sont encourus.

Les intérêts aux fins de l'attribution constituent les montants d'intérêt nominal reçus par les Fonds. Les Fonds n'amortissent pas les primes versées ou les escomptes reçus à l'achat de titres à revenu fixe.

Les revenus de dividendes sont comptabilisés à compter de la date ex-dividende.

Les revenus de distribution et les gains nets distribués par le fonds sous-jacent sont comptabilisés au moment de la distribution par le fonds sous-jacent et sont basés sur l'allocation établie par le gestionnaire de ce fonds. Les revenus de distribution par le fonds sous-jacent peuvent inclure des intérêts et des dividendes.

Les gains ou les pertes réalisés à la liquidation des instruments financiers dérivés sont inclus au poste « Gain net (perte nette) réalisé(e) sur les instruments financiers dérivés » à l'état du résultat global. Les gains et les pertes non réalisés sur les instruments financiers dérivés sont inclus au poste « Gain net (perte nette) non réalisé(e) sur les instruments financiers dérivés ».

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

2. PRINCIPALES MÉTHODES COMPTABLES (suite)

Impôts

Les Fonds peuvent être assujettis à des retenues d'impôt à la source sur les revenus de placement dans certains pays. Ces retenues d'impôt sont présentées distinctement à l'état du résultat global. Les Fonds sont considérés comme des fiducies de fonds distincts en vertu de la *Loi de l'impôt sur le revenu* (Canada) et de la *Loi sur les impôts* (Québec). De ce fait, les revenus de placements nets des Fonds ainsi que les gains et les pertes réalisés, s'il y a lieu, sont attribués aux souscripteurs de parts à la fin de l'année. Par conséquent, les Fonds ne sont assujettis à aucun impôt sur le revenu à l'exception de tout impôt étranger exigible.

Juste valeur des instruments financiers

L'existence de cotations publiées sur un marché actif constitue la meilleure indication de la juste valeur. La juste valeur des actions des titres négociés en Bourse et des dérivés cotés en Bourse est basée sur leur cours de clôture à la date de présentation de l'information financière lorsque ce cours se situe dans l'écart acheteur - vendeur. Si le cours de clôture ne se situe pas dans l'écart acheteur - vendeur, les Fonds déterminent le point de l'écart acheteur - vendeur le plus représentatif de la juste valeur. Si le marché d'un titre n'est pas actif, la juste valeur est établie par une technique d'évaluation faisant le plus possible appel aux données observées sur les marchés.

Les placements dans les fonds sous-jacents sont évalués à la valeur liquidative par part établie par le gestionnaire du fonds sous-jacent au jour d'évaluation.

La valeur comptable de la trésorerie et découvert bancaire ainsi que des autres éléments d'actif et de passif représente leur juste valeur en raison de leurs caractéristiques ou de leur échéance à court terme.

Les instruments financiers comptabilisés à la juste valeur à l'état de la situation financière sont classés selon une hiérarchie qui reflète l'importance des données utilisées pour établir les évaluations et comprend trois niveaux :

- Niveau 1 - Les prix (non rajustés) cotés sur des marchés actifs pour des actifs ou passifs identiques;
- Niveau 2 - Évaluation à partir de données observables sur le marché pour l'actif ou le passif, obtenues directement ou indirectement;
- Niveau 3 - Évaluation à partir de données autres que les données observables sur le marché pour l'actif ou le passif.

Un instrument financier est classé au niveau le plus bas de la hiérarchie pour lequel une donnée importante a été prise en compte dans l'évaluation de la juste valeur. Un changement dans la méthode d'évaluation de la juste valeur peut résulter d'un transfert entre niveaux. La méthodologie utilisée dans la classification des instruments financiers n'est pas une indication du niveau de risque associé au placement.

Entités structurées non consolidées

Les Fonds se sont engagés auprès d'entités structurées non consolidées, par le biais de leurs unités de fonds d'obligations et d'actions, qui sont établies aux fins de générer un rendement de placements. Bien qu'ils aient droit à une partie importante des rendements en raison des parts qu'ils détiennent, ces parts ne leur confèrent pas le pouvoir sur les activités pertinentes de ces entités. Ainsi, le contrôle de l'entité n'est pas établi en fonction des droits de vote. L'exposition maximale au risque de perte attribuable aux intérêts des Fonds se limite à la valeur de l'investissement dans ces entités structurées non consolidées.

Augmentation (diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part

L'augmentation (la diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs, par part est obtenue en divisant l'augmentation (la diminution) de l'actif net lié aux opérations effectuées pour le compte des souscripteurs de chaque classe d'un Fonds par la moyenne pondérée des parts en circulation au cours de l'exercice.

3. MODIFICATIONS DE MÉTHODES COMPTABLES

Nouvelles normes comptables futures

Présentation des états financiers

En janvier 2020, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 1 « Présentation des états financiers ». L'amendement vient préciser le critère concernant le droit de différer le règlement d'un passif pour au moins douze mois après la fin d'exercice, à prendre en compte lors du classement des passifs en tant que passifs courants ou non courants dans l'état de la situation financière. Les dispositions de cet amendement s'appliqueront rétrospectivement aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2022. Une application anticipée est autorisée. En juillet 2020, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 1 « Présentation des états financiers » reportant la date d'application de cet amendement aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2023. Une évaluation de l'incidence de cet amendement sur les états financiers des Fonds est actuellement en cours.

Présentation des états financiers

En février 2021, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 1 « Présentation des états financiers ». L'amendement vient préciser les informations à fournir sur les méthodes comptables en exigeant que les entités fournissent les informations significatives sur les méthodes comptables plutôt que sur les principales méthodes comptables. Les dispositions de cet amendement s'appliqueront de manière prospective aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2023. Une application anticipée est autorisée. Une évaluation de l'incidence de cet amendement sur les états financiers des Fonds est actuellement en cours.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

3. MODIFICATIONS DE MÉTHODES COMPTABLES (suite)

Nouvelles normes comptables futures (suite)

Méthodes comptables, changements d'estimations comptables et erreurs

En février 2021, l'IASB a publié un amendement à la norme IAS 8 « Méthodes comptables, changements d'estimations comptables et erreurs ». L'amendement introduit une définition des estimations comptables et clarifie la distinction entre un changement d'estimation comptable et un changement de méthode comptable. Les dispositions de cet amendement s'appliqueront de manière prospective aux états financiers ouverts à compter du 1^{er} janvier 2023. Une application anticipée est autorisée. Une évaluation de l'incidence de cet amendement sur les états financiers des Fonds est actuellement en cours.

4. ACTIF NET DÉTENU POUR LE COMPTE DES SOUSCRIPTEURS

L'actif net détenu pour le compte des souscripteurs de chaque Fonds se divise en parts d'égale valeur et représente l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs. Les parts des Fonds sont sans valeur nominale et peuvent être émises en nombre illimité. Le prix des parts de chaque classe d'un Fonds correspond à sa valeur liquidative par part avant prise en compte des opérations des souscripteurs de parts et des paiements du jour. Le prix des parts est obtenu en divisant la valeur liquidative de chaque classe du Fonds par le nombre de parts en circulation, les opérations sont ensuite prises en compte d'après le prix des parts de la journée. Le prix des parts est calculé à chaque jour d'évaluation, au bureau de la Société qui administre les Fonds, selon les valeurs de fin de journée.

5. EFFETS DE LA PANDÉMIE LIÉE À LA COVID-19 SUR LES ÉTATS FINANCIERS

Depuis mars 2020, l'épidémie de la maladie à coronavirus 2019 (« COVID-19 ») est considérée comme étant une pandémie mondiale par l'Organisation mondiale de la santé. Afin de contenir la pandémie, les gouvernements ont adopté plusieurs mesures afin de réduire la propagation du virus, ce qui a entraîné entre autres des restrictions au niveau des voyages et des déplacements non-essentiels, des fermetures de frontières, des annulations de grands événements culturels et sportifs, des mesures de confinements au sein de la population et des fermetures de commerces non-essentiels. Ces mesures ont eu des répercussions négatives importantes au niveau de l'économie mondiale et des marchés financiers. Afin d'en atténuer les effets négatifs sur l'économie et les marchés financiers et afin d'assurer une certaine stabilité, les gouvernements et les banques centrales ont instauré divers programmes d'aide à la population et aux entreprises ainsi que diverses interventions fiscales et monétaires. Cette pandémie amène un haut degré d'incertitude au niveau de sa progression, ne permettant pas d'en évaluer de façon fiable sa durée.

Les effets de la pandémie de COVID-19 ont touché principalement le poste des placements des états financiers des Fonds. Les variations des marchés boursiers et les mouvements des taux d'intérêt ont fait varier la juste valeur des instruments financiers détenus par les Fonds.

6. PARTS DES FONDS

Le tableau suivant présente le mouvement des parts des Fonds pour les exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 :

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Marché monétaire Fiera Capital				
Classe A				
2021	149 869	55 865	(95 607)	110 127
2020	131 285	121 470	(102 886)	149 869
Classe B				
2021	60 270	27 550	(16 045)	71 775
2020	69 075	101 293	(110 098)	60 270
Classe C				
2021	35	-	-	35
2020	3 640	3 610	(7 215)	35
Classe E				
2021	981 373	487 026	(836 784)	631 615
2020	363 588	1 627 946	(1 010 161)	981 373
Classe F				
2021	270 226	140 991	(175 232)	235 985
2020	70 191	517 640	(317 605)	270 226
Classe G				
2021	63 720	96 455	(73 968)	86 207
2020	64 608	177 092	(177 980)	63 720

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. 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 I				
2021	38 481	466 879	(456 958)	48 402
2020	18 408	77 509	(57 436)	38 481
Classe J				
2021	337 665	3 368 808	(3 624 269)	82 204
2020	435 855	2 158 066	(2 256 256)	337 665
Classe N				
2021	142 284	85 393	(96 787)	130 890
2020	131 448	326 101	(315 265)	142 284
Obligations court terme Fiera Capital				
Classe A				
2021	93 058	22 413	(42 888)	72 583
2020	91 573	55 217	(53 732)	93 058
Classe B				
2021	58 750	7 612	(21 395)	44 967
2020	55 550	27 735	(24 535)	58 750
Classe C				
2021	1 538	84	-	1 622
2020	1 453	85	-	1 538
Classe E				
2021	1 088 355	2 123 189	(2 469 216)	742 328
2020	530 298	2 012 096	(1 454 039)	1 088 355
Classe F				
2021	192 327	80 923	(130 818)	142 432
2020	180 095	157 337	(145 105)	192 327
Classe G				
2021	43 444	10 777	(8 913)	45 308
2020	51 514	28 344	(36 414)	43 444
Classe I				
2021	133 795	425 314	(414 775)	144 334
2020	120 192	111 259	(97 656)	133 795
Classe J				
2021	1 264 226	1 164 534	(2 036 014)	392 746
2020	1 186 536	660 372	(582 682)	1 264 226
Classe K				
2021	2 951 807	351 985	(152 984)	3 150 808
2020	3 216 224	334 985	(599 402)	2 951 807
Classe N				
2021	47 466	20 111	(25 634)	41 943
2020	83 938	57 218	(93 690)	47 466
Obligations Fiera Capital				
Classe A				
2021	552 866	77 393	(202 164)	428 095
2020	580 625	373 600	(401 359)	552 866
Classe B				
2021	351 256	62 366	(153 147)	260 475
2020	394 642	105 682	(149 068)	351 256
Classe C				
2021	357 948	17 576	(55 563)	319 961
2020	385 951	140 010	(168 013)	357 948

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations Fiera Capital (suite)				
Classe D				
2021	67 794	13 211	(36 826)	44 179
2020	119 315	22 884	(74 405)	67 794
Classe E				
2021	2 659 721	762 691	(1 457 860)	1 964 552
2020	1 784 722	2 533 312	(1 658 313)	2 659 721
Classe F				
2021	465 710	156 215	(176 894)	445 031
2020	370 730	203 478	(108 498)	465 710
Classe G				
2021	221 633	22 702	(55 826)	188 509
2020	322 901	95 558	(196 826)	221 633
Classe H				
2021	159 790	14 469	(46 517)	127 742
2020	158 734	191 632	(190 576)	159 790
Classe I				
2021	304 690	56 004	(265 103)	95 591
2020	249 089	178 081	(122 480)	304 690
Classe J				
2021	10 740 696	2 830 106	(5 754 013)	7 816 789
2020	11 877 532	2 396 297	(3 533 133)	10 740 696
Classe K				
2021	8 862 959	1 562 783	(619 560)	9 806 182
2020	9 634 379	1 012 390	(1 783 810)	8 862 959
Classe N				
2021	485 091	269 362	(115 666)	638 787
2020	467 975	183 382	(166 266)	485 091
Obligations PIMCO				
Classe A				
2021	212 436	32 197	(70 532)	174 101
2020	219 789	61 726	(69 079)	212 436
Classe B				
2021	155 230	25 062	(66 447)	113 845
2020	173 734	63 520	(82 024)	155 230
Classe C				
2021	485 445	13 474	(94 940)	403 979
2020	536 507	13 037	(64 099)	485 445
Classe E				
2021	2 131 020	732 670	(890 353)	1 973 337
2020	1 536 544	1 720 512	(1 126 036)	2 131 020
Classe F				
2021	369 230	132 415	(214 078)	287 567
2020	175 581	291 580	(97 931)	369 230
Classe G				
2021	183 224	41 785	(90 916)	134 093
2020	172 482	71 476	(60 734)	183 224
Classe I				
2021	252 440	106 769	(126 621)	232 588
2020	154 711	394 854	(297 125)	252 440

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations PIMCO (suite)				
Classe J				
2021	5 402 407	2 506 693	(3 197 024)	4 712 076
2020	5 796 321	997 117	(1 391 031)	5 402 407
Classe L				
2021	27 535	6 401	(17 431)	16 505
2020	12 540	22 450	(7 455)	27 535
Classe N				
2021	115 778	42 977	(29 545)	129 210
2020	95 452	39 043	(18 717)	115 778
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe				
Classe A				
2021	9 721	1 167	(1 695)	9 193
2020	8 381	6 530	(5 190)	9 721
Classe B				
2021	9 163	2 028	(8 368)	2 823
2020	11 159	3 581	(5 577)	9 163
Classe E				
2021	411 826	802 285	(936 298)	277 813
2020	433 323	167 393	(188 890)	411 826
Classe F				
2021	79 892	7 338	(36 240)	50 990
2020	92 872	39 949	(52 929)	79 892
Classe G				
2021	18 266	2 035	(1 617)	18 684
2020	19 417	3 399	(4 550)	18 266
Classe I				
2021	451 304	320 512	(584 999)	186 817
2020	103 939	487 161	(139 796)	451 304
Classe J				
2021	6 111 175	3 164 428	(1 101 854)	8 173 749
2020	4 440 645	2 936 542	(1 266 012)	6 111 175
Classe N				
2021	375 981	207 850	(43 023)	540 808
2020	269 410	190 779	(84 208)	375 981
Obligations mondiales PIMCO				
Classe A				
2021	64 404	16 963	(36 722)	44 645
2020	102 139	24 706	(62 441)	64 404
Classe B				
2021	42 658	16 132	(24 477)	34 313
2020	48 013	14 146	(19 501)	42 658
Classe C				
2021	35 359	10 771	(7 082)	39 048
2020	31 093	10 270	(6 004)	35 359
Classe E				
2021	867 888	247 025	(308 333)	806 580
2020	940 922	415 030	(488 064)	867 888
Classe F				
2021	216 316	35 435	(46 181)	205 570
2020	216 708	68 193	(68 585)	216 316

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDOS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Obligations mondiales PIMCO (suite)				
Classe G				
2021	165 300	26 861	(45 741)	146 420
2020	79 122	123 483	(37 305)	165 300
Classe I				
2021	528 666	215 210	(489 443)	254 433
2020	937 141	154 569	(563 044)	528 666
Classe J				
2021	3 127 935	1 077 220	(1 700 583)	2 504 572
2020	3 192 604	700 066	(764 735)	3 127 935
Classe L				
2021	8 092	116 646	-	124 738
2020	2 391	5 701	-	8 092
Classe N				
2021	200 472	76 199	(37 539)	239 132
2020	138 312	101 494	(39 334)	200 472
Obligations de sociétés CI Signature				
Classe A				
2021	40 015	28 261	(28 414)	39 862
2020	54 297	18 620	(32 902)	40 015
Classe B				
2021	28 399	11 353	(12 467)	27 285
2020	24 516	12 677	(8 794)	28 399
Classe E				
2021	1 266 150	765 484	(653 278)	1 378 356
2020	1 236 102	587 732	(557 684)	1 266 150
Classe F				
2021	291 964	118 544	(68 958)	341 550
2020	259 956	115 851	(83 843)	291 964
Classe G				
2021	126 266	97 488	(40 532)	183 222
2020	127 910	60 961	(62 605)	126 266
Classe I				
2021	166 749	468 204	(62 048)	572 905
2020	175 018	60 573	(68 842)	166 749
Classe J				
2021	293 003	151 770	(70 612)	374 161
2020	279 492	44 322	(30 811)	293 003
Classe N				
2021	39 015	35 457	(17 117)	57 355
2020	29 650	15 175	(5 810)	39 015
Indice obligataire BlackRock				
Classe A				
2021	33 687	5 848	(18 770)	20 765
2020	33 365	24 662	(24 340)	33 687
Classe B				
2021	12 259	6 016	(8 454)	9 821
2020	17 926	25 510	(31 177)	12 259
Classe C				
2021	14 673	(1)	(810)	13 862
2020	10 792	13 213	(9 332)	14 673

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (audités)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice obligataire BlackRock (suite)				
Classe E				
2021	264 370	99 292	(213 110)	150 552
2020	111 485	751 111	(598 226)	264 370
Classe F				
2021	57 348	62 764	(23 407)	96 705
2020	43 693	48 089	(34 434)	57 348
Classe G				
2021	11 423	28 117	(5 058)	34 482
2020	13 607	33 182	(35 366)	11 423
Classe I				
2021	29 382	691	(14 778)	15 295
2020	10 905	26 594	(8 117)	29 382
Classe J				
2021	1 423 352	4 482 920	(1 482 436)	4 423 836
2020	2 447 941	180 692	(1 205 281)	1 423 352
Classe N				
2021	35 918	580	(971)	35 527
2020	37 239	35 430	(36 751)	35 918
Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire				
Classe A				
2021	233 624	62 997	(123 934)	172 687
2020	247 492	82 098	(95 966)	233 624
Classe B				
2021	80 982	7 076	(20 697)	67 361
2020	81 577	16 160	(16 755)	80 982
Classe C				
2021	347 377	347	(29 394)	318 330
2020	370 863	37 013	(60 499)	347 377
Classe E				
2021	861 271	192 469	(310 132)	743 608
2020	722 988	1 225 682	(1 087 399)	861 271
Classe F				
2021	484 617	74 389	(217 807)	341 199
2020	361 068	282 917	(159 368)	484 617
Classe G				
2021	287 729	21 761	(136 967)	172 523
2020	218 032	126 714	(57 017)	287 729
Classe I				
2021	125 004	23 889	(9 061)	139 832
2020	108 839	24 423	(8 258)	125 004
Classe J				
2021	121	-	-	121
2020	121	-	-	121
Classe N				
2021	17 748	106	(5 447)	12 407
2020	70 140	21 176	(73 568)	17 748
Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré				
Classe A				
2021	274 253	39 757	(92 602)	221 408
2020	310 978	89 932	(126 657)	274 253

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Portefeuille bêta intelligent plus – équilibré (suite)				
Classe B				
2021	158 391	39 776	(64 186)	133 981
2020	213 393	26 962	(81 964)	158 391
Classe C				
2021	659 183	11 307	(108 498)	561 992
2020	765 034	44 622	(150 473)	659 183
Classe E				
2021	1 443 764	206 947	(737 358)	913 353
2020	1 244 350	1 332 425	(1 133 011)	1 443 764
Classe F				
2021	910 374	75 524	(324 614)	661 284
2020	839 026	301 116	(229 768)	910 374
Classe G				
2021	352 795	38 096	(103 746)	287 145
2020	441 469	84 441	(173 115)	352 795
Classe I				
2021	49 571	34 755	(7 966)	76 360
2020	52 479	3 218	(6 126)	49 571
Classe J				
2021	125	-	-	125
2020	125	-	-	125
Classe N				
2021	14 720	588	(7 361)	7 947
2020	14 917	46 934	(47 131)	14 720
Portefeuille bêta intelligent plus - croissance				
Classe A				
2021	182 318	14 924	(76 435)	120 807
2020	213 406	41 259	(72 347)	182 318
Classe B				
2021	17 896	213	(3 093)	15 016
2020	27 135	2 071	(11 310)	17 896
Classe C				
2021	365 912	6 144	(83 723)	288 333
2020	437 848	17 633	(89 569)	365 912
Classe E				
2021	358 192	45 208	(114 974)	288 426
2020	660 222	121 752	(423 782)	358 192
Classe F				
2021	318 410	27 934	(131 081)	215 263
2020	422 217	86 055	(189 862)	318 410
Classe G				
2021	124 160	7 446	(43 408)	88 198
2020	137 071	30 546	(43 457)	124 160
Classe I				
2021	6 048	-	(5 937)	111
2020	6 213	-	(165)	6 048
Classe J				
2021	127	-	-	127
2020	127	-	-	127

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Portefeuille bêta intelligent plus – croissance (suite)				
Classe N				
2021	1 889	1 813	(323)	3 379
2020	1 984	125	(220)	1 889
Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux				
Classe A				
2021	30 690	661	(5 492)	25 859
2020	41 945	4 431	(15 686)	30 690
Classe B				
2021	96 810	13 265	(44 453)	65 622
2020	106 038	45 484	(54 712)	96 810
Classe C				
2021	540 777	3 051	(222 591)	321 237
2020	495 822	252 260	(207 305)	540 777
Classe E				
2021	185 320	26 792	(63 894)	148 218
2020	274 185	70 101	(158 966)	185 320
Classe F				
2021	117 191	16 235	(34 571)	98 855
2020	122 491	27 210	(32 510)	117 191
Classe G				
2021	32 119	1 601	(10 509)	23 211
2020	50 476	13 055	(31 412)	32 119
Classe I				
2021	20 851	1 775	(2 171)	20 455
2020	22 189	976	(2 314)	20 851
Classe J				
2021	128	-	-	128
2020	128	-	-	128
Classe N				
2021	3 936	367	(999)	3 304
2020	3 523	6 451	(6 038)	3 936
Stratégie sécuritaire				
Classe A				
2021	831 431	187 149	(292 583)	725 997
2020	919 425	227 885	(315 879)	831 431
Classe B				
2021	578 840	128 975	(185 737)	522 078
2020	713 727	205 535	(340 422)	578 840
Classe C				
2021	485 611	29 109	(88 938)	425 782
2020	564 736	45 813	(124 938)	485 611
Classe E				
2021	3 914 445	2 430 453	(1 540 770)	4 804 128
2020	3 798 570	2 016 746	(1 900 871)	3 914 445
Classe F				
2021	1 052 891	429 312	(351 877)	1 130 326
2020	1 020 239	355 277	(322 625)	1 052 891
Classe G				
2021	1 082 557	147 027	(247 883)	981 701
2020	1 112 806	272 659	(302 908)	1 082 557

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie sécuritaire (suite)				
Classe I				
2021	100 702	447 323	(101 452)	446 573
2020	155 377	-	(54 675)	100 702
Classe J				
2021	84	-	-	84
2020	84	-	-	84
Classe L				
2021	353 715	10 224	(50 958)	312 981
2020	344 502	24 353	(15 140)	353 715
Classe N				
2021	217 790	15 839	(14 372)	219 257
2020	206 764	31 526	(20 500)	217 790
Stratégie équilibrée				
Classe A				
2021	1 727 595	254 232	(394 030)	1 587 797
2020	1 989 795	292 149	(554 349)	1 727 595
Classe B				
2021	1 171 061	199 916	(374 811)	996 166
2020	1 321 238	284 791	(434 968)	1 171 061
Classe C				
2021	1 526 004	111 931	(284 495)	1 353 440
2020	1 713 245	150 087	(337 328)	1 526 004
Classe E				
2021	4 731 718	1 912 172	(1 458 399)	5 185 491
2020	4 352 483	1 919 566	(1 540 331)	4 731 718
Classe F				
2021	1 466 322	618 748	(322 164)	1 762 906
2020	1 551 295	241 146	(326 119)	1 466 322
Classe G				
2021	1 154 768	134 241	(282 104)	1 006 905
2020	1 188 246	160 314	(193 792)	1 154 768
Classe I				
2021	227 119	62 648	(17 646)	272 121
2020	268 025	40 251	(81 157)	227 119
Classe J				
2021	1 409 823	447 682	(1 434 543)	422 962
2020	1 453 371	155 610	(199 158)	1 409 823
Classe L				
2021	1 340 204	152 344	(6 686)	1 485 862
2020	1 214 293	148 284	(22 373)	1 340 204
Classe N				
2021	797 090	137 146	(47 297)	886 939
2020	1 012 659	167 918	(383 487)	797 090
Stratégie croissance				
Classe A				
2021	485 660	57 906	(133 395)	410 171
2020	549 513	58 377	(122 230)	485 660
Classe B				
2021	193 176	23 192	(55 946)	160 422
2020	210 489	42 904	(60 217)	193 176

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie croissance (suite)				
Classe C				
2021	488 258	40 787	(66 312)	462 733
2020	573 228	60 472	(145 442)	488 258
Classe E				
2021	1 241 221	415 274	(321 172)	1 335 323
2020	1 055 454	502 881	(317 114)	1 241 221
Classe F				
2021	476 681	139 239	(133 415)	482 505
2020	348 764	202 757	(74 840)	476 681
Classe G				
2021	189 197	36 572	(74 963)	150 806
2020	205 547	49 111	(65 461)	189 197
Classe I				
2021	30 279	25 899	(8 713)	47 465
2020	21 732	10 176	(1 629)	30 279
Classe J				
2021	74	-	-	74
2020	74	-	-	74
Classe L				
2021	979 951	86 883	(125 486)	941 348
2020	728 224	257 420	(5 693)	979 951
Classe N				
2021	217 067	17 761	(13 535)	221 293
2020	268 722	17 933	(69 588)	217 067
Stratégie audacieuse				
Classe A				
2021	88 224	21 734	(25 541)	84 417
2020	112 940	19 320	(44 036)	88 224
Classe B				
2021	33 798	12 869	(15 131)	31 536
2020	37 451	12 524	(16 177)	33 798
Classe C				
2021	968 140	90 380	(117 362)	941 158
2020	896 281	257 567	(185 708)	968 140
Classe E				
2021	589 564	141 568	(150 910)	580 222
2020	535 060	151 246	(96 742)	589 564
Classe F				
2021	145 117	65 965	(48 982)	162 100
2020	126 125	53 321	(34 329)	145 117
Classe G				
2021	88 191	10 774	(24 373)	74 592
2020	87 337	20 626	(19 772)	88 191
Classe I				
2021	875	4 682	(95)	5 462
2020	893	-	(18)	875
Classe J				
2021	78	-	-	78
2020	78	-	-	78

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Stratégie audacieuse (suite)				
Classe L				
2021	394 884	32 007	(17 095)	409 796
2020	382 290	21 594	(9 000)	394 884
Classe N				
2021	62 936	6 912	(33 431)	36 417
2020	62 143	2 305	(1 512)	62 936
Stratégie 100% actions				
Classe A				
2021	-	500	(1)	499
2020	-	-	-	-
Classe B				
2021	-	500	(5)	495
2020	-	-	-	-
Classe E				
2021	-	1 826	-	1 826
2020	-	-	-	-
Classe F				
2021	-	500	(2)	498
2020	-	-	-	-
Classe G				
2021	-	500	(4)	496
2020	-	-	-	-
Classe I				
2021	-	100	-	100
2020	-	-	-	-
Classe J				
2021	-	100	-	100
2020	-	-	-	-
Classe L				
2021	-	100	-	100
2020	-	-	-	-
Classe N				
2021	-	507	-	507
2020	-	-	-	-
Celestia sécuritaire				
Classe A				
2021	373 170	66 294	(163 773)	275 691
2020	437 032	78 595	(142 457)	373 170
Classe B				
2021	157 753	50 966	(73 040)	135 679
2020	176 759	51 952	(70 958)	157 753
Classe C				
2021	449 708	6 113	(102 036)	353 785
2020	523 921	45 340	(119 553)	449 708
Classe E				
2021	2 917 819	555 676	(850 324)	2 623 171
2020	3 423 389	601 456	(1 107 026)	2 917 819
Classe F				
2021	1 213 614	237 417	(285 818)	1 165 213
2020	1 335 895	260 361	(382 642)	1 213 614

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Celestia sécuritaire (suite)				
Classe G				
2021	489 150	49 220	(120 988)	417 382
2020	576 708	60 638	(148 196)	489 150
Classe I				
2021	13 095	27 207	(11 079)	29 223
2020	21 159	7 031	(15 095)	13 095
Classe J				
2021	84	-	-	84
2020	84	-	-	84
Classe N				
2021	176 336	33 497	(38 743)	171 090
2020	143 046	61 647	(28 357)	176 336
Celestia équilibré				
Classe A				
2021	685 758	70 555	(196 866)	559 447
2020	816 726	84 892	(215 860)	685 758
Classe B				
2021	298 597	58 073	(121 882)	234 788
2020	367 899	54 621	(123 923)	298 597
Classe C				
2021	1 041 144	54 080	(195 713)	899 511
2020	1 203 725	31 528	(194 109)	1 041 144
Classe E				
2021	3 363 047	695 595	(1 030 959)	3 027 683
2020	4 205 306	487 488	(1 329 747)	3 363 047
Classe F				
2021	1 220 222	282 340	(360 838)	1 141 724
2020	1 431 040	193 029	(403 847)	1 220 222
Classe G				
2021	563 535	100 654	(181 278)	482 911
2020	694 564	96 939	(227 968)	563 535
Classe I				
2021	118 392	45 184	(17 465)	146 111
2020	144 756	48 112	(74 476)	118 392
Classe J				
2021	82	-	-	82
2020	82	-	-	82
Classe N				
2021	610 102	37 725	(59 579)	588 248
2020	656 581	58 583	(105 062)	610 102
Celestia croissance				
Classe A				
2021	154 139	20 193	(44 422)	129 910
2020	175 092	18 120	(39 073)	154 139
Classe B				
2021	75 291	45 099	(55 466)	64 924
2020	86 232	17 024	(27 965)	75 291
Classe C				
2021	668 613	45 044	(150 054)	563 603
2020	756 650	14 590	(102 627)	668 613

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. 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				
2021	1 128 938	487 954	(480 633)	1 136 259
2020	1 554 387	182 058	(607 507)	1 128 938
Classe F				
2021	294 006	139 719	(84 085)	349 640
2020	316 181	76 350	(98 525)	294 006
Classe G				
2021	269 414	129 248	(142 236)	256 426
2020	334 631	75 666	(140 883)	269 414
Classe I				
2021	18 332	37 633	(34 975)	20 990
2020	22 337	2 611	(6 616)	18 332
Classe J				
2021	79	-	-	79
2020	79	-	-	79
Classe N				
2021	176 063	17 737	(11 892)	181 908
2020	179 364	16 188	(19 489)	176 063
Celestia audacieux				
Classe A				
2021	73 545	4 009	(25 893)	51 661
2020	77 213	9 714	(13 382)	73 545
Classe B				
2021	36 799	6 694	(16 076)	27 417
2020	43 290	15 543	(22 034)	36 799
Classe C				
2021	831 081	43 629	(119 312)	755 398
2020	747 139	223 213	(139 271)	831 081
Classe D				
2021	88 566	910	(46 121)	43 355
2020	149 693	1 143	(62 270)	88 566
Classe E				
2021	360 559	138 400	(161 014)	337 945
2020	473 918	60 792	(174 151)	360 559
Classe F				
2021	152 014	33 428	(45 293)	140 149
2020	155 670	26 437	(30 093)	152 014
Classe G				
2021	96 289	49 266	(43 104)	102 451
2020	141 482	13 900	(59 093)	96 289
Classe H				
2021	372 416	49 696	(133 426)	288 686
2020	349 581	106 471	(83 636)	372 416
Classe I				
2021	79 763	47 509	(59 489)	67 783
2020	43 577	44 925	(8 739)	79 763
Classe J				
2021	79	-	-	79
2020	79	-	-	79

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Celestia audacieux (suite)				
Classe N				
2021	33 455	3 751	(924)	36 282
2020	31 776	3 319	(1 640)	33 455
Celestia 100% actions				
Classe A				
2021	-	500	(1)	499
2020	-	-	-	-
Classe B				
2021	-	500	(5)	495
2020	-	-	-	-
Classe E				
2021	-	27 577	(3 286)	24 291
2020	-	-	-	-
Classe F				
2021	-	500	(2)	498
2020	-	-	-	-
Classe G				
2021	-	500	(4)	496
2020	-	-	-	-
Classe I				
2021	-	100	-	100
2020	-	-	-	-
Classe J				
2021	-	100	-	100
2020	-	-	-	-
Classe N				
2021	-	500	-	500
2020	-	-	-	-
Revenu sécuritaire Guardian				
Classe A				
2021	54 741	3 936	(22 128)	36 549
2020	73 588	13 644	(32 491)	54 741
Classe B				
2021	46 941	1 020	(27 728)	20 233
2020	76 069	7 680	(36 808)	46 941
Classe C				
2021	22 790	120	(1 615)	21 295
2020	25 648	1 414	(4 272)	22 790
Classe E				
2021	1 468 657	383 462	(555 913)	1 296 206
2020	1 778 253	359 302	(668 898)	1 468 657
Classe F				
2021	562 428	130 135	(133 133)	559 430
2020	585 449	152 816	(175 837)	562 428
Classe G				
2021	186 058	32 419	(29 281)	189 196
2020	192 790	51 101	(57 833)	186 058
Classe I				
2021	33 011	8 607	(1 040)	40 578
2020	35 238	(1)	(2 226)	33 011

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Revenu sécuritaire Guardian (suite)				
Classe J				
2021	102	-	-	102
2020	102	-	-	102
Classe L				
2021	36 144	-	(1 743)	34 401
2020	39 573	3 280	(6 709)	36 144
Classe N				
2021	69 318	4 533	(15 151)	58 700
2020	509	74 771	(5 962)	69 318
Revenu Guardian				
Classe A				
2021	46 082	4 829	(10 122)	40 789
2020	82 864	23 284	(60 066)	46 082
Classe B				
2021	23 237	2 022	(946)	24 313
2020	27 592	8 349	(12 704)	23 237
Classe C				
2021	79 704	5 298	(22 013)	62 989
2020	317 816	26 582	(264 694)	79 704
Classe E				
2021	1 523 148	614 495	(885 787)	1 251 856
2020	1 871 641	503 516	(852 009)	1 523 148
Classe F				
2021	962 341	78 638	(184 860)	856 119
2020	1 101 128	211 812	(350 599)	962 341
Classe G				
2021	298 774	38 180	(44 884)	292 070
2020	221 365	171 202	(93 793)	298 774
Classe I				
2021	78 710	9 909	(6 241)	82 378
2020	70 995	26 555	(18 840)	78 710
Classe J				
2021	102	-	-	102
2020	102	-	-	102
Classe L				
2021	35 421	1 860	(2 614)	34 667
2020	41 508	1 932	(8 019)	35 421
Classe N				
2021	68 141	36 017	(50 483)	53 675
2020	72 753	55 297	(59 909)	68 141
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge				
Classe A				
2021	1 576 596	258 793	(474 401)	1 360 988
2020	1 906 878	210 339	(540 621)	1 576 596
Classe B				
2021	1 003 126	188 738	(371 220)	820 644
2020	1 195 255	106 761	(298 890)	1 003 126
Classe C				
2021	1 762 784	91 197	(291 343)	1 562 638
2020	1 961 107	72 243	(270 566)	1 762 784

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDOS (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 E				
2021	3 106 119	389 583	(669 280)	2 826 422
2020	3 969 461	503 234	(1 366 576)	3 106 119
Classe F				
2021	1 215 152	200 953	(419 894)	996 211
2020	1 579 676	270 400	(634 924)	1 215 152
Classe G				
2021	658 123	113 110	(216 181)	555 052
2020	842 568	140 568	(325 013)	658 123
Classe I				
2021	128 237	40 377	(19 074)	149 540
2020	191 008	1 208	(63 979)	128 237
Classe J				
2021	127	-	-	127
2020	127	-	-	127
Classe L				
2021	285 285	4 553	(29 036)	260 802
2020	388 723	5 550	(108 988)	285 285
Classe N				
2021	197 492	29 722	(43 660)	183 554
2020	175 901	23 112	(1 521)	197 492
Revenu et croissance mondial CI Signature				
Classe A				
2021	1 059 333	318 244	(398 197)	979 380
2020	1 124 373	431 412	(496 452)	1 059 333
Classe B				
2021	718 377	96 452	(202 676)	612 153
2020	871 726	75 075	(228 424)	718 377
Classe C				
2021	1 448 415	357 333	(247 794)	1 557 954
2020	1 723 325	559 278	(834 188)	1 448 415
Classe E				
2021	11 579 055	3 723 628	(2 732 062)	12 570 621
2020	13 120 827	3 501 439	(5 043 211)	11 579 055
Classe F				
2021	6 864 699	2 341 513	(1 652 010)	7 554 202
2020	5 979 847	2 798 024	(1 913 172)	6 864 699
Classe G				
2021	1 674 731	385 807	(446 852)	1 613 686
2020	1 901 614	490 753	(717 636)	1 674 731
Classe I				
2021	595 932	221 784	(109 702)	708 014
2020	573 523	218 257	(195 848)	595 932
Classe J				
2021	152	-	-	152
2020	152	-	-	152
Classe L				
2021	1 110 129	85 746	(33 332)	1 162 543
2020	1 038 151	100 239	(28 261)	1 110 129

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Revenu et croissance mondial CI Signature (suite)				
Classe N				
2021	239 690	32 477	(59 942)	212 225
2020	242 133	47 304	(49 747)	239 690
Actions canadiennes dividendes Guardian				
Classe A				
2021	229 468	59 893	(116 326)	173 035
2020	283 197	31 606	(85 335)	229 468
Classe B				
2021	233 662	33 148	(109 358)	157 452
2020	294 462	28 788	(89 588)	233 662
Classe E				
2021	900 624	400 164	(312 753)	988 035
2020	1 054 936	387 662	(541 974)	900 624
Classe F				
2021	538 605	160 475	(182 542)	516 538
2020	626 897	86 371	(174 663)	538 605
Classe G				
2021	1 203 498	504 025	(989 951)	717 572
2020	1 554 440	140 967	(491 909)	1 203 498
Classe I				
2021	50 175	32 056	(30 796)	51 435
2020	66 203	1 743	(17 771)	50 175
Classe J				
2021	1 233 617	72 344	(318 589)	987 372
2020	346 455	986 693	(99 531)	1 233 617
Classe L				
2021	152 346	81 872	(6 446)	227 772
2020	156 793	-	(4 447)	152 346
Classe N				
2021	32 999	6 467	(1 740)	37 726
2020	25 689	19 478	(12 168)	32 999
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée				
Classe A				
2021	518 954	89 416	(171 307)	437 063
2020	595 261	66 979	(143 286)	518 954
Classe B				
2021	307 088	51 580	(128 172)	230 496
2020	353 471	54 854	(101 237)	307 088
Classe D				
2021	83 892	342	(52 968)	31 266
2020	184 029	(1)	(100 136)	83 892
Classe E				
2021	652 388	326 984	(161 517)	817 855
2020	741 587	189 630	(278 829)	652 388
Classe F				
2021	263 338	61 834	(59 463)	265 709
2020	267 946	52 382	(56 990)	263 338
Classe G				
2021	200 021	41 022	(64 275)	176 768
2020	251 001	28 399	(79 379)	200 021

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée (suite)				
Classe H				
2021	180 751	28 748	(35 628)	173 871
2020	190 166	50 938	(60 353)	180 751
Classe I				
2021	275 174	96 180	(71 753)	299 601
2020	324 714	110 926	(160 466)	275 174
Classe J				
2021	5 528 059	472 505	(1 941 161)	4 059 403
2020	4 590 043	1 901 463	(963 447)	5 528 059
Classe N				
2021	211 246	59 586	(33 191)	237 641
2020	176 448	65 469	(30 671)	211 246
Actions canadiennes Triasima				
Classe A				
2021	272 415	51 168	(77 527)	246 056
2020	318 391	40 406	(86 382)	272 415
Classe B				
2021	232 976	28 893	(67 340)	194 529
2020	278 831	23 603	(69 458)	232 976
Classe D				
2021	34 358	-	(22 377)	11 981
2020	57 288	153	(23 083)	34 358
Classe E				
2021	870 541	534 125	(287 076)	1 117 590
2020	795 665	452 852	(377 976)	870 541
Classe F				
2021	401 727	99 745	(96 952)	404 520
2020	437 679	78 413	(114 365)	401 727
Classe G				
2021	174 858	24 702	(46 891)	152 669
2020	218 104	32 512	(75 758)	174 858
Classe H				
2021	60 217	25 354	(21 387)	64 184
2020	80 217	23 944	(43 944)	60 217
Classe I				
2021	77 817	99 750	(25 388)	152 179
2020	94 012	46 231	(62 426)	77 817
Classe J				
2021	7 679 599	800 802	(2 716 485)	5 763 916
2020	8 274 223	1 695 104	(2 289 728)	7 679 599
Classe K				
2021	4 997 294	312 454	(1 261 013)	4 048 735
2020	5 344 581	979 027	(1 326 314)	4 997 294
Classe L				
2021	100	17 670	(100)	17 670
2020	100	-	-	100
Classe N				
2021	178 211	21 720	(20 481)	179 450
2020	155 260	46 782	(23 831)	178 211

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice canadien BlackRock				
Classe A				
2021	36 179	5 975	(11 458)	30 696
2020	45 764	8 151	(17 736)	36 179
Classe B				
2021	241 953	10 128	(56 969)	195 112
2020	254 040	21 710	(33 797)	241 953
Classe D				
2021	60 488	95	(37 212)	23 371
2020	111 751	255	(51 518)	60 488
Classe E				
2021	207 335	144 426	(162 989)	188 772
2020	184 923	116 720	(94 308)	207 335
Classe F				
2021	49 667	13 101	(13 075)	49 693
2020	67 890	18 679	(36 902)	49 667
Classe G				
2021	39 316	5 136	(16 182)	28 270
2020	44 753	8 397	(13 834)	39 316
Classe H				
2021	125 043	18 417	(27 082)	116 378
2020	131 040	26 053	(32 050)	125 043
Classe I				
2021	26 750	11 419	(9 411)	28 758
2020	27 097	42	(389)	26 750
Classe J				
2021	79 758	116	(79 330)	544
2020	147 467	1 116	(68 825)	79 758
Classe N				
2021	30 943	7 014	(676)	37 281
2020	31 094	3 494	(3 645)	30 943
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital				
Classe A				
2021	129 739	39 005	(59 234)	109 510
2020	151 321	15 009	(36 591)	129 739
Classe B				
2021	91 553	14 528	(32 733)	73 348
2020	101 831	11 350	(21 628)	91 553
Classe E				
2021	259 510	229 347	(81 202)	407 655
2020	259 563	107 773	(107 826)	259 510
Classe F				
2021	187 603	62 554	(66 426)	183 731
2020	178 546	64 218	(55 161)	187 603
Classe G				
2021	45 710	14 041	(15 979)	43 772
2020	70 315	8 275	(32 880)	45 710
Classe I				
2021	53 820	24 368	(18 086)	60 102
2020	47 352	36 754	(30 286)	53 820

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital (suite)				
Classe J				
2021	62 570	3 044	(9 923)	55 691
2020	66 798	12 762	(16 990)	62 570
Classe N				
2021	35 354	9 471	(5 539)	39 286
2020	34 093	18 248	(16 987)	35 354
Actions américaines Hillsdale				
Classe A				
2021	16 762	4 499	(5 668)	15 593
2020	18 895	7 118	(9 251)	16 762
Classe B				
2021	5 244	1 881	(2 345)	4 780
2020	7 602	1 284	(3 642)	5 244
Classe E				
2021	124 098	171 566	(106 944)	188 720
2020	169 428	36 855	(82 185)	124 098
Classe F				
2021	103 838	33 024	(21 055)	115 807
2020	121 839	14 192	(32 193)	103 838
Classe G				
2021	28 452	17 216	(12 227)	33 441
2020	35 584	15 044	(22 176)	28 452
Classe I				
2021	10 214	11 603	(10 756)	11 061
2020	13 399	315	(3 500)	10 214
Classe J				
2021	1 060 302	44 392	(293 529)	811 165
2020	1 186 564	187 642	(313 904)	1 060 302
Classe K				
2021	819 828	27 923	(197 966)	649 785
2020	872 161	109 372	(161 705)	819 828
Classe L				
2021	131 215	43 644	(45 156)	129 703
2020	116 382	14 833	-	131 215
Classe N				
2021	3 586	2 567	(87)	6 066
2020	5 677	3 990	(6 081)	3 586
Actions américaines Beutel Goodman				
Classe A				
2021	207 771	25 450	(48 569)	184 652
2020	249 851	22 334	(64 414)	207 771
Classe B				
2021	125 868	34 069	(58 094)	101 843
2020	156 453	8 957	(39 542)	125 868
Classe E				
2021	828 110	366 115	(237 459)	956 766
2020	1 068 643	162 903	(403 436)	828 110
Classe F				
2021	391 400	94 116	(149 905)	335 611
2020	603 462	66 412	(278 474)	391 400

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDs (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions américaines Beutel Goodman (suite)				
Classe G				
2021	287 642	48 892	(106 575)	229 959
2020	373 972	50 025	(136 355)	287 642
Classe I				
2021	27 178	84 340	(16 916)	94 602
2020	28 388	-	(1 210)	27 178
Classe J				
2021	122	-	-	122
2020	122	-	-	122
Classe N				
2021	35 819	4 782	(2 583)	38 018
2020	43 173	1 105	(8 459)	35 819
Actions américaines Fiera Capital				
Classe A				
2021	325 991	64 579	(91 786)	298 784
2020	364 536	121 489	(160 034)	325 991
Classe B				
2021	222 045	43 134	(74 417)	190 762
2020	261 119	62 167	(101 241)	222 045
Classe D				
2021	77 827	865	(43 904)	34 788
2020	139 259	3 959	(65 391)	77 827
Classe E				
2021	2 426 021	1 287 848	(769 067)	2 944 802
2020	1 831 438	1 778 079	(1 183 496)	2 426 021
Classe F				
2021	1 140 619	487 158	(232 715)	1 395 062
2020	807 667	567 887	(234 935)	1 140 619
Classe G				
2021	653 550	185 152	(164 061)	674 641
2020	572 177	277 856	(196 483)	653 550
Classe H				
2021	314 256	55 643	(70 244)	299 655
2020	308 384	114 083	(108 211)	314 256
Classe I				
2021	219 246	146 021	(51 764)	313 503
2020	329 399	48 527	(158 680)	219 246
Classe J				
2021	10 332	34	(10 332)	34
2020	10 404	-	(72)	10 332
Classe N				
2021	170 238	31 972	(19 032)	183 178
2020	206 663	36 421	(72 846)	170 238
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital				
Classe A				
2021	35 491	8 663	(5 158)	38 996
2020	29 160	20 685	(14 354)	35 491
Classe B				
2021	1 769	2 998	(1 605)	3 162
2020	4 463	6 517	(9 211)	1 769

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FOND(S) (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital (suite)				
Classe E				
2021	665 012	353 961	(242 994)	775 979
2020	562 704	405 484	(303 176)	665 012
Classe F				
2021	243 133	105 741	(67 119)	281 755
2020	204 301	139 899	(101 067)	243 133
Classe G				
2021	45 381	18 948	(14 944)	49 385
2020	38 601	27 953	(21 173)	45 381
Classe I				
2021	269 516	75 116	(211 023)	133 609
2020	85 893	310 096	(126 473)	269 516
Classe J				
2021	100	-	-	100
2020	100	-	-	100
Classe N				
2021	28 306	3 480	(4 217)	27 569
2020	8 094	28 817	(8 605)	28 306
Indice américain BlackRock				
Classe A				
2021	186 332	35 182	(48 885)	172 629
2020	285 200	24 285	(123 153)	186 332
Classe B				
2021	89 667	16 297	(31 798)	74 166
2020	107 002	20 335	(37 670)	89 667
Classe D				
2021	63 880	2 351	(37 234)	28 997
2020	100 652	274	(37 046)	63 880
Classe E				
2021	1 266 825	618 696	(531 606)	1 353 915
2020	1 158 666	673 804	(565 645)	1 266 825
Classe F				
2021	398 462	104 143	(156 015)	346 590
2020	427 874	127 338	(156 750)	398 462
Classe G				
2021	141 368	46 719	(76 395)	111 692
2020	181 964	54 342	(94 938)	141 368
Classe H				
2021	211 032	33 431	(47 698)	196 765
2020	267 105	23 201	(79 274)	211 032
Classe I				
2021	332 255	112 002	(51 432)	392 825
2020	375 501	112 149	(155 395)	332 255
Classe J				
2021	82	-	-	82
2020	82	-	-	82
Classe N				
2021	219 399	79 430	(48 288)	250 541
2020	189 538	81 375	(51 514)	219 399

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (audités)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher				
Classe A				
2021	-	1 304	(2)	1 302
2020	-	-	-	-
Classe B				
2021	-	500	(5)	495
2020	-	-	-	-
Classe E				
2021	-	58 543	(927)	57 616
2020	-	-	-	-
Classe F				
2021	-	1 733	(4)	1 729
2020	-	-	-	-
Classe G				
2021	-	500	(5)	495
2020	-	-	-	-
Classe I				
2021	-	4 378	(4 278)	100
2020	-	-	-	-
Classe J				
2021	-	1 000 000	(7 211)	992 789
2020	-	-	-	-
Classe N				
2021	-	505	-	505
2020	-	-	-	-
Actions internationales QQG Partners				
Classe A				
2021	-	983	(2)	981
2020	-	-	-	-
Classe B				
2021	-	500	(5)	495
2020	-	-	-	-
Classe E				
2021	-	3 081	-	3 081
2020	-	-	-	-
Classe F				
2021	-	1 973	(4)	1 969
2020	-	-	-	-
Classe G				
2021	-	500	(4)	496
2020	-	-	-	-
Classe I				
2021	-	4 947	(110)	4 837
2020	-	-	-	-
Classe J				
2021	1 427 333	681 299	(113 027)	1 995 605
2020	-	1 430 827	(3 494)	1 427 333
Classe N				
2021	-	177 368	(1 832)	175 536
2020	-	-	-	-

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions internationales C WorldWide				
Classe A				
2021	117 981	37 167	(30 788)	124 360
2020	119 608	52 994	(54 621)	117 981
Classe B				
2021	54 082	4 082	(12 510)	45 654
2020	43 139	25 064	(14 121)	54 082
Classe D				
2021	16 743	-	(9 371)	7 372
2020	-	17 343	(600)	16 743
Classe E				
2021	729 840	223 198	(198 482)	754 556
2020	712 720	319 677	(302 557)	729 840
Classe F				
2021	217 698	63 256	(75 118)	205 836
2020	205 258	65 707	(53 267)	217 698
Classe G				
2021	101 895	21 292	(32 739)	90 448
2020	112 883	52 819	(63 807)	101 895
Classe H				
2021	89 655	8 220	(17 041)	80 834
2020	-	89 810	(155)	89 655
Classe I				
2021	305 595	88 462	(113 863)	280 194
2020	210 464	152 332	(57 201)	305 595
Classe J				
2021	5 752 229	1 767 378	(1 102 375)	6 417 232
2020	5 906 684	1 112 125	(1 266 580)	5 752 229
Classe K				
2021	1 524 246	134 232	(193 743)	1 464 735
2020	1 826 796	60 071	(362 621)	1 524 246
Classe L				
2021	78 376	49 170	(24 470)	103 076
2020	62 160	16 216	-	78 376
Classe N				
2021	51 225	119 676	(20 393)	150 508
2020	33 236	43 997	(26 008)	51 225
Indice international BlackRock				
Classe A				
2021	20 051	2 253	(4 926)	17 378
2020	31 386	5 096	(16 431)	20 051
Classe B				
2021	18 276	4 557	(5 590)	17 243
2020	20 231	2 772	(4 727)	18 276
Classe D				
2021	19 958	274	(9 579)	10 653
2020	31 313	151	(11 506)	19 958
Classe E				
2021	176 740	28 253	(25 015)	179 978
2020	439 385	26 082	(288 727)	176 740

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDSD (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Indice international BlackRock (suite)				
Classe F				
2021	41 667	10 807	(13 676)	38 798
2020	44 044	6 053	(8 430)	41 667
Classe G				
2021	22 842	3 568	(10 313)	16 097
2020	25 766	5 117	(8 041)	22 842
Classe H				
2021	161 596	13 952	(21 496)	154 052
2020	145 660	56 532	(40 596)	161 596
Classe I				
2021	10 533	4 138	(366)	14 305
2020	21 437	51	(10 955)	10 533
Classe J				
2021	4 635 722	272 089	(4 256 631)	651 180
2020	3 285 040	2 156 385	(805 703)	4 635 722
Classe N				
2021	199 776	50 882	(229 553)	21 105
2020	13 564	205 077	(18 865)	199 776
Actions mondiales dividendes TD				
Classe A				
2021	43 773	7 117	(18 796)	32 094
2020	54 334	9 659	(20 220)	43 773
Classe B				
2021	28 458	2 502	(6 019)	24 941
2020	36 321	471	(8 334)	28 458
Classe E				
2021	557 455	157 437	(161 291)	553 601
2020	602 122	167 592	(212 259)	557 455
Classe F				
2021	357 382	30 867	(84 400)	303 849
2020	425 553	45 140	(113 311)	357 382
Classe G				
2021	135 909	24 195	(59 570)	100 534
2020	187 241	33 639	(84 971)	135 909
Classe I				
2021	36 680	18 483	(24 758)	30 405
2020	37 275	7 220	(7 815)	36 680
Classe J				
2021	355 720	152 074	(105 379)	402 415
2020	723 167	156 817	(524 264)	355 720
Classe L				
2021	351 610	20 591	(23 091)	349 110
2020	296 451	67 334	(12 175)	351 610
Classe N				
2021	17 617	1 130	(3 634)	15 113
2020	26 064	4 340	(12 787)	17 617
Actions mondiales Fiera Capital				
Classe A				
2021	102 779	31 856	(30 380)	104 255
2020	54 764	85 862	(37 847)	102 779

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDs (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions mondiales Fiera Capital (suite)				
Classe B				
2021	193 948	19 596	(49 071)	164 473
2020	27 033	182 935	(16 020)	193 948
Classe D				
2021	12 426	1 524	(5 805)	8 145
2020	-	12 549	(123)	12 426
Classe E				
2021	2 046 734	1 085 340	(660 627)	2 471 447
2020	1 494 244	1 561 936	(1 009 446)	2 046 734
Classe F				
2021	907 538	229 696	(214 683)	922 551
2020	647 873	453 833	(194 168)	907 538
Classe G				
2021	218 157	73 131	(96 784)	194 504
2020	167 861	136 841	(86 545)	218 157
Classe H				
2021	115 657	104 621	(49 144)	171 134
2020	-	115 930	(273)	115 657
Classe I				
2021	104 373	190 151	(64 777)	229 747
2020	119 216	98 826	(113 669)	104 373
Classe J				
2021	6 339 124	4 196 171	(3 704 619)	6 830 676
2020	7 542 361	2 101 973	(3 305 210)	6 339 124
Classe L				
2021	170 379	91 897	(19 163)	243 113
2020	41 974	131 466	(3 061)	170 379
Classe N				
2021	174 185	78 599	(48 873)	203 911
2020	125 223	96 138	(47 176)	174 185
Actions mondiales GQG Partners				
Classe A				
2021	-	1 638	(1)	1 637
2020	-	-	-	-
Classe B				
2021	-	500	(5)	495
2020	-	-	-	-
Classe E				
2021	-	24 148	(921)	23 227
2020	-	-	-	-
Classe F				
2021	-	5 636	(11)	5 625
2020	-	-	-	-
Classe G				
2021	-	500	(4)	496
2020	-	-	-	-
Classe I				
2021	-	170 113	(1 481)	168 632
2020	-	-	-	-

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions mondiales GQG Partners (suite)				
Classe J				
2021	668 604	284 599	(507 162)	446 041
2020	-	679 789	(11 185)	668 604
Classe N				
2021	27 253	14 203	(1 839)	39 617
2020	-	27 254	(1)	27 253
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher				
Classe A				
2021	113 445	13 906	(21 796)	105 555
2020	135 991	14 249	(36 795)	113 445
Classe B				
2021	50 734	8 439	(17 411)	41 762
2020	52 370	12 753	(14 389)	50 734
Classe E				
2021	573 581	492 590	(232 577)	833 594
2020	498 160	268 166	(192 745)	573 581
Classe F				
2021	318 984	145 095	(107 155)	356 924
2020	346 313	71 557	(98 886)	318 984
Classe G				
2021	98 112	22 283	(32 505)	87 890
2020	130 772	14 274	(46 934)	98 112
Classe I				
2021	192 352	67 936	(38 031)	222 257
2020	134 604	177 032	(119 284)	192 352
Classe J				
2021	5 038 500	2 061 368	(1 731 650)	5 368 218
2020	5 180 192	1 050 370	(1 192 062)	5 038 500
Classe N				
2021	54 903	19 075	(5 280)	68 698
2020	40 552	21 192	(6 841)	54 903
Actions marchés émergents Fisher				
Classe A				
2021	43 989	20 510	(16 460)	48 039
2020	48 990	13 711	(18 712)	43 989
Classe B				
2021	27 437	7 332	(20 098)	14 671
2020	22 620	10 887	(6 070)	27 437
Classe E				
2021	308 590	265 174	(194 423)	379 341
2020	240 830	178 804	(111 044)	308 590
Classe F				
2021	179 742	77 084	(74 915)	181 911
2020	111 959	107 352	(39 569)	179 742
Classe G				
2021	27 777	12 226	(13 732)	26 271
2020	19 828	11 374	(3 425)	27 777
Classe I				
2021	112 051	43 715	(86 154)	69 612
2020	72 311	62 096	(22 356)	112 051

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDIS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Actions marchés émergents Fisher (suite)				
Classe J				
2021	4 318 884	1 150 483	(1 312 973)	4 156 394
2020	4 512 732	1 007 376	(1 201 224)	4 318 884
Classe L				
2021	2 021	23 640	(100)	25 561
2020	100	1 921	-	2 021
Classe N				
2021	88 292	48 539	(13 724)	123 107
2020	74 434	39 558	(25 700)	88 292
Infrastructures mondiales Lazard				
Classe A				
2021	103 890	19 916	(36 736)	87 070
2020	136 267	20 325	(52 702)	103 890
Classe B				
2021	40 805	5 898	(14 034)	32 669
2020	57 963	8 591	(25 749)	40 805
Classe E				
2021	1 015 209	378 157	(315 848)	1 077 518
2020	967 016	697 249	(649 056)	1 015 209
Classe F				
2021	527 350	68 742	(178 416)	417 676
2020	560 252	112 530	(145 432)	527 350
Classe I				
2021	188 316	86 045	(53 243)	221 118
2020	256 217	90 974	(158 875)	188 316
Classe J				
2021	2 406 419	1 565 715	(497 910)	3 474 224
2020	2 890 782	441 098	(925 461)	2 406 419
Classe L				
2021	251 790	53 241	(72 221)	232 810
2020	209 167	47 806	(5 183)	251 790
Classe N				
2021	126 134	20 860	(8 644)	138 350
2020	112 016	55 898	(41 780)	126 134
Immobilier mondial CI				
Classe A				
2021	-	27 946	(5 141)	22 805
2020	-	-	-	-
Classe B				
2021	-	10 643	(2 658)	7 985
2020	-	-	-	-
Classe E				
2021	-	173 092	(28 426)	144 666
2020	-	-	-	-
Classe F				
2021	-	142 880	(19 335)	123 545
2020	-	-	-	-
Classe I				
2021	-	61 777	(948)	60 829
2020	-	-	-	-

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

6. PARTS DES FONDS (suite)

Fonds	Parts en circulation au début	Parts émises	Parts rachetées	Parts en circulation à la fin
Immobilier mondial CI (suite)				
Classe J				
2021	-	194 655	(163 938)	30 717
2020	-	-	-	-
Classe L				
2021	-	78 285	-	78 285
2020	-	-	-	-
Classe N				
2021	-	144 889	(20 992)	123 897
2020	-	-	-	-

7. FRAIS DE GESTION ET D'ADMINISTRATION

En contrepartie des frais de gestion, la Société fournit des services de conseil en placement et en gestion. La Société perçoit également des Fonds des frais d'administration et prend à sa charge les honoraires d'audit, les honoraires juridiques, les frais d'assurance, les frais de tenue des registres, les frais bancaires, les frais de garde et de dépôt, les frais des services aux souscripteurs de parts, les frais de rapports financiers, les frais de comptabilité et d'évaluation des Fonds, les taxes ainsi que les frais associés à la Notice explicative et à la communication des renseignements aux souscripteurs de parts et tous les autres frais engagés par les Fonds.

Le ratio des frais de gestion (RFG) est établi d'après le total des charges de l'exercice (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 l'exercice. Le RFG de chacun des Fonds est présenté dans la section « informations financières »

8. TRANSACTIONS ENTRE PARTIES LIÉES

Dans le cours normal des activités, les Fonds versent des frais de gestion à la Société (note 7). Ces frais sont calculés et versés à la Société quotidiennement en fonction de la valeur liquidative des Fonds.

La gestion des Fonds est effectuée par la Société, qui occupe la fonction de principal dirigeant.

Pour l'exercice terminé le 31 décembre 2021, un montant total de 53 658 \$ (31 décembre 2020 – 48 411 \$) a été transféré par l'ensemble des Fonds à la Société à titre de frais de gestion.

Lors du lancement d'un Fonds, la Société peut injecter des capitaux dans le Fonds. Le tableau suivant présente aux 31 décembre 2021 et 2020, les justes valeurs des capitaux de lancement injectés par la Société:

Fonds	31 décembre 2021 (\$)	31 décembre 2020 (\$)
Marché monétaire Fiera Capital	10	5
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe	5	5
Stratégie 100 %actions	36	-
Celestia 100 % actions	35	-
Actions américaines Beutel Goodman	5	4
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital	16	13
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher	33	-
Actions mondiales GQG Partners	28	-
Actions internationales GQG Partners	32	-

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

9. RISQUES FINANCIERS LIÉS AUX INSTRUMENTS FINANCIERS

Dans le cours normal des activités, les Fonds sont exposés à divers risques financiers, dont le risque de crédit, le risque de liquidité, le risque de marché incluant le risque de taux d'intérêt, le risque de prix et le risque de change ainsi que le risque de concentration. Les Fonds sont constitués de placements qui peuvent fluctuer à tous les jours selon l'évolution des marchés, la conjoncture économique, les taux d'intérêt et l'information relative aux sociétés, plus particulièrement celle touchant les titres composant les Fonds ou les fonds sous-jacents.

L'exposition des Fonds aux risques dépend des stratégies de placement ainsi que des types de placement composant les portefeuilles. Les résultats des analyses de sensibilité aux risques auxquels les Fonds sont exposés représentent la meilleure estimation de la direction. Les résultats réels pourraient différer de façon significative.

Une analyse des risques financiers auxquels les Fonds sont exposés est présentée dans les notes spécifiques accompagnant les états financiers de chacun des Fonds.

Risque de crédit

Le risque de crédit correspond au risque de perte financière pour les Fonds si un débiteur ne respecte pas ses engagements. Les placements à revenu fixe et les instruments financiers dérivés sont les principaux instruments financiers sujets au risque de crédit. La valeur comptable représente l'exposition maximale au risque de crédit à la fin de l'exercice.

De plus, les opérations de prêts de titres exposent les Fonds au risque de crédit. Le risque de crédit lié à ces opérations est minime étant donné que la valeur des actifs détenus en garantie par chaque Fonds représente au minimum 102 % de la juste valeur des titres prêtés.

Risque de liquidité

Le risque de liquidité correspond au risque que les Fonds ne soient pas en mesure de respecter leurs obligations en temps opportun en raison de leur incapacité à liquider leurs actifs. Les Fonds sont exposés à ce risque en raison des rachats quotidiens de parts.

Risque de taux d'intérêt

Le risque de taux d'intérêt correspond au risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations des taux d'intérêt en vigueur sur le marché.

Les Fonds sont exposés au risque de taux d'intérêt lorsqu'ils détiennent des instruments financiers portant intérêt. En effet, les Fonds sont exposés au risque que la valeur des instruments financiers fluctue par suite d'une variation des taux d'intérêt sur le marché. Les fluctuations des taux d'intérêt ont peu d'incidence sur la trésorerie et les titres de marché monétaire.

Risque de prix

Le risque de prix correspond au risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier fluctuent en raison des variations du marché, autres que celles découlant du risque de change ou de taux d'intérêt, que ces variations soient causées par des facteurs propres à l'instrument financier ou à son émetteur, ou par des facteurs affectant tous les instruments financiers similaires négociés sur le marché. Tous les placements de titres peuvent présenter un risque de prix. La juste valeur des placements représente le risque de prix maximal à la fin de l'exercice.

Risque de change

Le risque de change correspond au risque que la juste valeur ou les flux de trésorerie futurs d'un instrument financier, libellés dans une devise autre que le dollar canadien, fluctuent en raison des variations des cours des devises étrangères. Les Fonds sont exposés au risque de change lorsqu'ils détiennent des éléments d'actif ou de passif libellés dans une devise autre que le dollar canadien, puisque la valeur des titres libellés en devises variera en fonction des taux de change en vigueur.

Risque de concentration

Les concentrations de risque résultent d'instruments financiers qui présentent des caractéristiques similaires et sont affectés de façon similaire par des changements dans la situation économique ou d'autres conditions. Le risque de concentration découle de la concentration des positions dans une même catégorie, que ce soit un emplacement géographique, un type de produit, un secteur d'activité ou un type de contrepartie.

10. 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.

FONDS SSQ

NOTES COMPLÉMENTAIRES AUX ÉTATS FINANCIERS (auditées)

Exercices terminés les 31 décembre 2021 et 2020 (en milliers de dollars)

10. GESTION DES RISQUES FINANCIERS (suite)

Processus de sélection des gestionnaires externes

Le processus de recherche et de sélection d'un gestionnaire externe est enclenché pour répondre aux besoins d'un nouveau produit, pour améliorer l'offre des Fonds ou pour remplacer un gestionnaire externe existant. La politique de gestion des gestionnaires externes prévoit les critères d'analyse pour le choix du gestionnaire externe et les étapes du processus de sélection en définissant les niveaux d'approbation requis.

Évaluation de la performance des gestionnaires externes

La Société rencontre régulièrement les gestionnaires externes et effectue un suivi régulier de la performance de chacun afin de réagir rapidement à tout événement susceptible d'avoir un impact sur la performance des Fonds.

Des vérifications mensuelles et trimestrielles sont effectuées. La performance de chacun des gestionnaires externes est comparée avec un indice de référence. L'allocation sectorielle, les principaux titres ainsi que la volatilité du portefeuille des Fonds et des fonds sous-jacents sont analysés. Une mise à jour de l'analyse qualitative de chaque gestionnaire externe est également effectuée périodiquement afin de déceler des mouvements au sein de l'organisation, ainsi que des changements dans le style de gestion et la politique de placement.

La politique de gestion des gestionnaires externes prévoit également les paramètres pouvant éventuellement mener à la remise en question du mandat d'un gestionnaire externe.

Fonds de fonds

La Société a confié la gestion des risques du Fonds au gestionnaire externe du fonds sous-jacent.

La politique de gestion des gestionnaires externes prévoit le suivi et l'évaluation de la performance des gestionnaires des fonds sous-jacents. Ainsi, les vérifications périodiques incluent une analyse de la performance et le suivi qualitatif de chacun des gestionnaires.

11. 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.

Rapport de l'auditeur indépendant

Aux souscripteurs de parts des Fonds SSQ suivants :

Fonds SSQ Marché monétaire Fiera Capital	Fonds SSQ Revenu sécuritaire Guardian
Fonds SSQ Obligations court terme Fiera Capital	Fonds SSQ Revenu Guardian
Fonds SSQ Obligations Fiera Capital	Fonds SSQ Revenu et croissance mondial CI Signature
Fonds SSQ Obligations PIMCO	Fonds SSQ Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge
Fonds SSQ Obligations et prêts bancaires AlphaFixe	Fonds SSQ Actions américaines à petite capitalisation Fisher
Fonds SSQ Obligations mondiales PIMCO	Fonds SSQ Actions internationales GQG Partners
Fonds SSQ Obligations de sociétés CI Signature	Fonds SSQ Actions mondiales GQG Partners
Fonds SSQ Indice international BlackRock	Fonds SSQ Actions mondiales à petite capitalisation Fisher
Fonds SSQ Indice obligataire BlackRock	Fonds SSQ Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital
Fonds SSQ Indice américain BlackRock	Fonds SSQ Actions mondiales Fiera Capital
Fonds SSQ Indice canadien BlackRock	Fonds SSQ Actions américaines Beutel Goodman
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus – audacieux	Fonds SSQ Actions américaines Fiera Capital
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus – croissance	Fonds SSQ Actions mondiales dividendes TD
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus – équilibré	Fonds SSQ Actions canadiennes dividendes Guardian
Fonds SSQ Portefeuille bêta intelligent plus – sécuritaire	Fonds SSQ Actions marchés émergents Fisher
Fonds SSQ Stratégie croissance	Fonds SSQ Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital
Fonds SSQ Stratégie sécuritaire	Fonds SSQ Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée
Fonds SSQ Stratégie équilibrée	Fonds SSQ Actions canadiennes Triasima
Fonds SSQ Stratégie audacieuse	Fonds SSQ Actions internationales C WorldWide
Fonds SSQ Celestia 100 % actions	Fonds SSQ Actions américaines Hillsdale
Fonds SSQ Celestia audacieux	Fonds SSQ Immobilier mondial CI
Fonds SSQ Celestia croissance	Fonds SSQ Infrastructures mondiales Lazard
Fonds SSQ Celestia équilibré	Fonds SSQ Stratégie 100 % actions
Fonds SSQ Celestia sécuritaire	

(chacun individuellement, le « Fonds »)

Opinion

Nous avons effectué l'audit des états financiers du Fonds, qui comprennent les états de la situation financière aux 31 décembre 2021 et 2020, et les états du résultat global, les états de l'évolution de l'actif net détenu pour le compte des souscripteurs et les états des flux de trésorerie pour les exercices clos à ces dates, ainsi que les notes annexes, y compris le résumé des principales méthodes comptables.

À notre avis, les états financiers ci-joints donnent, dans tous leurs aspects significatifs, une image fidèle de la situation financière du Fonds aux 31 décembre 2021 et 2020, ainsi que des résultats de sa performance financière et de ses flux de trésorerie pour les exercices clos à ces dates, conformément aux Normes internationales d'information financière (IFRS).

Fondement de l'opinion

Nous avons effectué notre audit conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers » du présent rapport. Nous sommes indépendants du Fonds conformément aux règles de déontologie qui s'appliquent à l'audit des états financiers au Canada et nous nous sommes acquittés des autres responsabilités déontologiques qui nous incombent selon ces règles. Nous estimons que les éléments probants que nous avons obtenus sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit.

Autre point

Les états financiers du Fonds pour l'exercice clos le 31 décembre 2020 ont été audités par un autre auditeur qui a exprimé sur ces états une opinion non modifiée le 26 février 2021.

Responsabilités de la direction et des responsables de la gouvernance à l'égard des états financiers

La direction est responsable de la préparation et de la présentation fidèle des états financiers conformément aux IFRS, ainsi que du contrôle interne qu'elle considère comme nécessaire pour permettre la préparation d'états financiers exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs.

Lors de la préparation des états financiers, c'est à la direction qu'il incombe d'évaluer la capacité du Fonds à poursuivre son exploitation, de communiquer, le cas échéant, les questions relatives à la continuité de l'exploitation et d'appliquer le principe comptable de continuité d'exploitation, sauf si la direction a l'intention de liquider le Fonds ou de cesser son activité ou si aucune solution réaliste ne s'offre à elle.

Il incombe aux responsables de la gouvernance de surveiller le processus d'information financière du Fonds.

Responsabilités de l'auditeur à l'égard de l'audit des états financiers

Nos objectifs sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers pris dans leur ensemble sont exempts d'anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, et de délivrer un rapport de l'auditeur contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent résulter de fraudes ou d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément aux normes d'audit généralement reconnues du Canada, nous exerçons notre jugement professionnel et faisons preuve d'esprit critique tout au long de cet audit. En outre :

- Nous identifions et évaluons les risques que les états financiers comportent des anomalies significatives, que celles-ci résultent de fraudes ou d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne;
- Nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds;
- Nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la direction, de même que des informations y afférentes fournies par cette dernière;
- Nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par la direction du principe comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité du Fonds à poursuivre son exploitation. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport sur les informations fournies dans les états financiers au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport. Des événements ou situations futurs pourraient par ailleurs amener le Fonds à cesser son exploitation;
- Nous évaluons la présentation d'ensemble, la structure et le contenu des états financiers, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle;

Nous communiquons aux responsables de la gouvernance notamment l'étendue et le calendrier prévus des travaux d'audit et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de notre audit.

Ernst & Young s.r.l./s.e.n.c.r.l.¹

Québec, Canada
Le 25 février 2022

¹ CPA auditeur, CA, permis de comptabilité publique n° A133737

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

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.

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Marché monétaire Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe B	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe C	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe E	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe F	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe G	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe I	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe J	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Valeur liquidative par part, Classe N	10,00	10,00	10,00	10,00	10,00
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	13 972	20 439	12 881	9 134	5 986
Nombre de parts en circulation**	1 397 240	2 043 923	1 288 098	913 494	598 613
Ratio des frais de gestion, Classe A	1,64	1,67	1,65	1,65	1,64
Ratio des frais de gestion, Classe B	1,65	1,66	1,65	2,42	2,40
Ratio des frais de gestion, Classe C	1,23	1,51	1,52	1,57	1,62
Ratio des frais de gestion, Classe E	1,63	1,66	1,64	1,63	1,62
Ratio des frais de gestion, Classe F	1,63	1,64	1,62	1,63	1,62
Ratio des frais de gestion, Classe G	1,61	1,64	1,55	1,63	1,65
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,05	0,04	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,05	0,04	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe N	1,64	1,66	1,66	1,65	1,64
Taux de rotation des titres en portefeuille	s.o.	s.o.	s.o.	s.o.	s.o.
Obligations court terme Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,15	11,44	11,01	10,83	10,82
Valeur liquidative par part, Classe B	10,85	11,14	10,72	10,54	10,62
Valeur liquidative par part, Classe C	11,18	11,46	11,02	10,84	10,82
Valeur liquidative par part, Classe E	11,16	11,45	11,02	10,84	10,82
Valeur liquidative par part, Classe F	11,18	11,47	11,04	10,85	10,83
Valeur liquidative par part, Classe G	11,11	11,41	10,98	10,80	10,79
Valeur liquidative par part, Classe I	12,66	12,73	12,00	11,56	11,31
Valeur liquidative par part, Classe J	12,66	12,73	12,00	11,56	11,31
Valeur liquidative par part, Classe K	12,66	12,73	12,00	11,56	11,31
Valeur liquidative par part, Classe N	11,15	11,44	11,01	10,83	10,82
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	58 844	72 800	65 198	53 724	57 559
Nombre de parts en circulation**	4 779 071	5 874 766	5 517 373	4 704 968	5 137 405
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,07	2,07	2,07	2,07	2,07
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,06	2,06	2,07	2,92	2,92

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Obligations court terme Fiera Capital (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe C	1,97	1,99	2,03	2,03	2,05
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,05	2,05	2,05	2,05	2,06
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,05	2,05	2,02	2,01	1,99
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,06	2,06	2,06	2,16	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	2,07	2,07	2,07
Taux de rotation des titres en portefeuille	29,22	158,75	197,03	112,01	48,98
Obligations Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	12,02	12,66	11,72	11,25	11,30
Valeur liquidative par part, Classe B	11,69	12,31	11,40	10,94	11,09
Valeur liquidative par part, Classe C	12,05	12,68	11,74	11,27	11,31
Valeur liquidative par part, Classe D	11,89	12,52	11,59	11,12	11,21
Valeur liquidative par part, Classe E	12,05	12,69	11,74	11,27	11,31
Valeur liquidative par part, Classe F	12,04	12,68	11,73	11,26	11,30
Valeur liquidative par part, Classe G	12,00	12,63	11,69	11,22	11,28
Valeur liquidative par part, Classe H	11,89	12,52	11,59	11,12	11,21
Valeur liquidative par part, Classe I	13,82	14,23	12,88	12,09	11,87
Valeur liquidative par part, Classe J	13,82	14,23	12,88	12,09	11,87
Valeur liquidative par part, Classe K	13,82	14,23	12,88	12,09	11,87
Valeur liquidative par part, Classe N	12,04	12,68	11,74	11,27	11,31
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	297 974	350 516	333 883	311 676	303 153
Nombre de parts en circulation**	22 135 893	25 230 154	26 346 595	26 141 307	25 750 461
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,27	2,29	2,29	2,33	2,32
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,28	2,29	2,29	3,21	3,20
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,27	2,28	2,29	2,27	2,27
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,28	2,29	2,30	2,68	2,68
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,26	2,27	2,27	2,27	2,26
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,25	2,26	2,27	2,30	2,29
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,26	2,27	2,27	2,41	2,40
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,28	2,29	2,30	2,68	2,68
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,05	0,04	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,05	0,04	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,04	0,05	0,05	0,04	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,28	2,29	2,29	2,28	2,27
Taux de rotation des titres en portefeuille	9,00	14,34	6,67	11,11	7,99
Obligations PIMCO					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,52	12,04	11,06	10,49	10,61
Valeur liquidative par part, Classe B	11,21	11,71	10,75	10,20	10,41
Valeur liquidative par part, Classe C	11,55	12,06	11,08	10,51	10,62
Valeur liquidative par part, Classe E	11,55	12,06	11,07	10,51	10,62

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Obligations PIMCO (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe F	11,54	12,05	11,06	10,49	10,62
Valeur liquidative par part, Classe G	11,50	12,01	11,03	10,46	10,59
Valeur liquidative par part, Classe I	13,34	13,61	12,21	11,31	11,17
Valeur liquidative par part, Classe J	13,34	13,61	12,21	11,31	11,17
Valeur liquidative par part, Classe L	11,91	12,15	10,90	10,10	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,54	12,06	11,07	10,50	10,62
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	103 219	121 286	104 953	105 671	105 714
Nombre de parts en circulation**	8 177 301	9 334 745	8 873 661	9 567 659	9 647 028
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,43	2,45	2,46	2,50	2,51
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,42	2,45	2,45	3,38	3,39
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,42	2,45	2,44	2,45	2,46
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,42	2,45	2,45	2,45	2,46
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,41	2,44	2,44	2,49	2,49
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,39	2,43	2,44	2,59	2,59
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,10	0,10	0,10	0,10	0,11
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,10	0,10	0,10	0,10	0,11
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,10	0,10	0,10	0,10	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,42	2,45	2,46	2,46	2,47
Taux de rotation des titres en portefeuille	17,16	16,63	17,19	7,36	3,27
Obligations et prêts bancaires AlphaFixe					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,52	10,77	10,33	9,87	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,47	10,72	10,28	9,82	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,53	10,78	10,33	9,88	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,53	10,78	10,33	9,87	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,52	10,77	10,32	9,86	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,49	11,47	10,73	10,01	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,49	11,47	10,73	10,01	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,53	10,78	10,33	9,88	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	105 533	85 050	57 396	60 667	-
Nombre de parts en circulation**	9 260 877	7 467 328	5 379 146	6 068 522	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,50	2,51	2,51	2,65	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,50	2,51	2,51	3,54	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,50	2,51	2,50	2,55	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,49	2,50	2,48	2,64	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,49	2,50	2,47	2,79	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,04	0,04	0,08	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,04	0,04	0,08	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,50	2,51	2,51	2,55	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	14,25	10,19	22,07	1,34	-
Obligations mondiales PIMCO					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,34	11,60	11,24	10,77	11,05
Valeur liquidative par part, Classe B	11,02	11,28	10,92	10,47	10,84

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Obligations mondiales PIMCO (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe C	11,37	11,64	11,27	10,81	11,07
Valeur liquidative par part, Classe E	11,38	11,64	11,28	10,81	11,08
Valeur liquidative par part, Classe F	11,36	11,62	11,25	10,79	11,06
Valeur liquidative par part, Classe G	11,30	11,56	11,19	10,72	11,01
Valeur liquidative par part, Classe I	13,47	13,41	12,64	11,78	11,75
Valeur liquidative par part, Classe J	13,47	13,41	12,64	11,79	11,75
Valeur liquidative par part, Classe L	11,49	11,43	10,77	10,05	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,37	11,63	11,27	10,80	11,07
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	55 816	67 623	69 726	51 233	56 098
Nombre de parts en circulation**	4 399 451	5 257 090	5 688 445	4 506 749	4 924 399
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,76	2,76	2,76	2,86	2,86
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,74	2,75	2,75	3,75	3,75
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,75	2,75	2,75	2,75	2,76
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,75	2,75	2,75	2,75	2,74
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,72	2,71	2,73	2,83	2,80
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,67	2,70	2,75	3,00	3,00
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,76	2,76	2,76	2,76	2,76
Taux de rotation des titres en portefeuille	13,07	11,88	10,73	16,05	3,88
Obligations de sociétés CI Signature					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,75	11,52	11,04	10,23	10,45
Valeur liquidative par part, Classe B	11,53	11,31	10,83	10,04	10,35
Valeur liquidative par part, Classe E	11,78	11,55	11,06	10,25	10,46
Valeur liquidative par part, Classe F	11,77	11,54	11,05	10,23	10,45
Valeur liquidative par part, Classe G	11,72	11,49	11,01	10,20	10,43
Valeur liquidative par part, Classe I	13,52	12,91	12,03	10,85	10,78
Valeur liquidative par part, Classe J	13,52	12,91	12,03	10,85	10,78
Valeur liquidative par part, Classe N	11,77	11,55	11,06	10,25	10,46
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	36 665	26 605	24 610	25 459	27 038
Nombre de parts en circulation**	2 974 696	2 251 561	2 186 941	2 446 048	2 565 405
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,70	2,70	2,70	2,80	2,80
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,70	2,70	2,70	3,70	3,70
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,66	2,69	2,69	2,70	2,70
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,63	2,65	2,65	2,77	2,80
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,66	2,67	2,68	2,93	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	2,70	2,70	2,70	2,70
Taux de rotation des titres en portefeuille	16,12	17,13	34,21	16,48	3,24
Valeur liquidative par part, Classe A	12,05	12,64	11,88	11,37	11,47

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Indice obligataire BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe B	11,72	12,30	11,56	11,06	11,26
Valeur liquidative par part, Classe C	12,07	12,66	11,90	11,39	11,49
Valeur liquidative par part, Classe E	12,08	12,67	11,91	11,39	11,49
Valeur liquidative par part, Classe F	12,08	12,67	11,90	11,38	11,48
Valeur liquidative par part, Classe G	12,02	12,61	11,85	11,34	11,45
Valeur liquidative par part, Classe I	13,85	14,21	13,06	12,22	12,06
Valeur liquidative par part, Classe J	13,85	14,21	13,06	12,22	12,05
Valeur liquidative par part, Classe N	12,09	12,69	11,92	11,40	11,49
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	65 834	26 082	35 299	38 984	40 413
Nombre de parts en circulation**	4 800 845	1 882 412	2 726 953	3 209 394	3 366 447
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,25	2,25	2,25	2,30	2,30
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,25	2,25	2,24	3,18	3,18
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,23	2,25	2,25	2,25	2,25
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,22	2,22	2,23	2,24	2,23
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,22	2,20	2,19	2,24	2,27
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,24	2,24	2,24	2,36	2,38
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	0,01	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	0,01	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,21	2,20	2,21	2,21	2,22
Taux de rotation des titres en portefeuille	47,34	37,34	7,94	19,46	12,96
Portefeuille bêta intelligent plus - sécuritaire					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,97	10,40	10,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,98	10,40	10,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	10,99	10,41	10,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,98	10,40	10,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,00	10,41	10,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,99	10,40	10,15	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,72	10,82	10,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,72	10,82	10,29	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,98	10,40	10,15	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	21 722	25 417	22 153	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 968 068	2 438 473	2 181 120	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,62	2,62	2,62	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,61	2,61	2,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,55	2,55	2,55	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,61	2,61	2,61	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,56	2,54	2,52	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,55	2,57	2,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,04	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,04	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,62	2,63	2,62	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	4,36	43,83	-	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Portefeuille bêta intelligent plus - équilibré					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,08	10,13	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,08	10,13	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	11,09	10,13	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,09	10,13	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,12	10,15	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,09	10,13	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,85	10,55	10,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,85	10,55	10,33	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,08	10,13	10,18	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	31 827	39 176	39 523	-	-
Nombre de parts en circulation**	2 863 595	3 863 176	3 881 771	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,68	2,68	2,67	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,67	2,68	2,68	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,66	2,66	2,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,66	2,66	2,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,57	2,55	2,55	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,64	2,65	2,65	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,04	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,04	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,68	2,68	2,68	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	9,14	34,30	-	-	-
Portefeuille bêta intelligent plus - croissance					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,05	9,93	10,17	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,04	9,93	10,17	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	11,04	9,93	10,17	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,05	9,94	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,08	9,95	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,06	9,94	10,18	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,83	10,35	10,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,82	10,35	10,32	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,04	9,93	10,17	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	11 273	13 669	19 399	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 019 660	1 374 952	1 906 223	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,71	2,71	2,71	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,73	2,73	2,73	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,71	2,72	2,71	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,69	2,68	2,68	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,57	2,59	2,60	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,66	2,65	2,66	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,04	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,04	0,04	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,74	2,74	2,74	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Portefeuille bêta intelligent plus – croissance (suite)					
Taux de rotation des titres en portefeuille	12,72	7,76	-	-	-
Portefeuille bêta intelligent plus - audacieux					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,10	9,81	10,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,10	9,81	10,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe C	11,11	9,82	10,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,10	9,81	10,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,12	9,82	10,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	11,10	9,81	10,19	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,90	10,24	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,90	10,24	10,34	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,10	9,81	10,19	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	7 868	10 100	11 383	-	-
Nombre de parts en circulation**	706 889	1 027 822	1 116 797	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,78	2,79	2,79	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,79	2,79	2,79	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,75	2,74	2,74	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,78	2,77	2,77	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,69	2,70	2,71	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,78	2,78	2,78	-	-
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	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,76	2,78	2,79	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	14,22	24,32	-	-	-
Stratégie sécuritaire					
Valeur liquidative par part, Classe A	14,83	14,20	13,33	12,27	12,69
Valeur liquidative par part, Classe B	14,41	13,80	12,95	11,92	12,44
Valeur liquidative par part, Classe C	14,93	14,29	13,41	12,35	12,75
Valeur liquidative par part, Classe E	14,93	14,30	13,42	12,35	12,75
Valeur liquidative par part, Classe F	14,87	14,24	13,36	12,30	12,71
Valeur liquidative par part, Classe G	14,78	14,15	13,28	12,22	12,65
Valeur liquidative par part, Classe I	17,62	16,43	15,00	13,45	13,50
Valeur liquidative par part, Classe J	17,67	16,47	15,05	13,48	13,54
Valeur liquidative par part, Classe L	15,69	14,63	13,36	11,97	12,03
Valeur liquidative par part, Classe N	14,93	14,29	13,42	12,35	12,75
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	143 753	122 962	118 163	109 954	98 963
Nombre de parts en circulation**	9 568 907	8 618 066	8 836 230	8 950 765	7 816 183
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,72	2,73	2,73	2,94	2,94
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,72	2,73	2,73	3,86	3,86
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,72	2,73	2,73	2,74	2,74
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,72	2,72	2,72	2,73	2,73
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,70	2,72	2,72	2,88	2,86
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,70	2,71	2,71	3,07	3,07

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Stratégie sécuritaire (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,70	2,71	2,71	3,07	3,07
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,72	2,73	2,73	2,74	2,74
Taux de rotation des titres en portefeuille	10,65	17,16	6,69	39,21	4,68
Stratégie équilibrée					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,49	15,12	13,91	12,42	13,16
Valeur liquidative par part, Classe B	16,10	14,76	13,57	12,12	12,94
Valeur liquidative par part, Classe C	16,68	15,29	14,06	12,56	13,26
Valeur liquidative par part, Classe E	16,68	15,29	14,06	12,56	13,26
Valeur liquidative par part, Classe F	16,53	15,15	13,93	12,45	13,17
Valeur liquidative par part, Classe G	16,35	14,98	13,78	12,31	13,07
Valeur liquidative par part, Classe I	19,75	17,62	15,76	13,70	14,06
Valeur liquidative par part, Classe J	19,75	17,62	15,76	13,70	14,06
Valeur liquidative par part, Classe L	17,81	15,88	14,21	12,35	12,68
Valeur liquidative par part, Classe N	16,67	15,29	14,06	12,56	13,26
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	251 840	240 885	227 518	212 567	232 527
Nombre de parts en circulation**	14 960 589	15 551 704	16 064 650	16 909 691	17 571 491
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,78	2,79	2,79	3,15	3,15
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,78	2,78	2,79	3,92	3,92
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,78	2,78	2,78	2,79	2,80
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,78	2,78	2,78	2,79	2,79
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,77	2,77	2,78	3,09	3,09
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,77	2,77	2,77	3,44	3,44
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,78	2,78	2,79	2,80	2,80
Taux de rotation des titres en portefeuille	18,30	17,69	8,97	32,67	6,80
Stratégie croissance					
Valeur liquidative par part, Classe A	19,87	17,66	16,14	14,14	15,18
Valeur liquidative par part, Classe B	19,49	17,32	15,82	13,86	14,98
Valeur liquidative par part, Classe C	20,18	17,94	16,39	14,36	15,34
Valeur liquidative par part, Classe E	20,19	17,94	16,40	14,36	15,34
Valeur liquidative par part, Classe F	19,94	17,72	16,19	14,18	15,21
Valeur liquidative par part, Classe G	19,64	17,45	15,94	13,96	15,05
Valeur liquidative par part, Classe I	24,00	20,74	18,42	15,69	16,30
Valeur liquidative par part, Classe J	24,12	20,84	18,51	15,77	16,37
Valeur liquidative par part, Classe L	19,51	16,86	14,97	12,75	13,25
Valeur liquidative par part, Classe N	20,18	17,94	16,39	14,36	15,34
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	84 129	75 742	63 534	56 666	58 636

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Stratégie croissance (suite)					
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	84 129	75 742	63 534	56 666	58 636
Nombre de parts en circulation**	4 212 140	4 301 564	3 961 747	4 053 035	3 928 431
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,84	2,84	2,85	3,35	3,35
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,84	2,84	2,84	3,97	3,97
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,84	2,84	2,85	2,85	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,83	2,84	2,84	2,85	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,81	2,83	2,84	3,25	3,25
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,82	2,82	2,82	3,73	3,75
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,03	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,84	2,84	2,85	2,85	2,85
Taux de rotation des titres en portefeuille	12,84	21,06	9,68	30,04	6,04
Stratégie audacieuse					
Valeur liquidative par part, Classe A	19,19	16,69	15,26	13,22	14,30
Valeur liquidative par part, Classe B	18,73	16,30	14,90	12,91	14,07
Valeur liquidative par part, Classe C	19,49	16,96	15,50	13,43	14,45
Valeur liquidative par part, Classe E	19,50	16,96	15,51	13,43	14,45
Valeur liquidative par part, Classe F	19,24	16,72	15,28	13,23	14,30
Valeur liquidative par part, Classe G	18,89	16,43	15,02	13,00	14,14
Valeur liquidative par part, Classe I	23,34	19,72	17,51	14,73	15,39
Valeur liquidative par part, Classe J	23,46	19,82	17,60	14,81	15,47
Valeur liquidative par part, Classe L	20,97	17,71	15,73	13,23	13,82
Valeur liquidative par part, Classe N	19,49	16,96	15,50	13,43	14,45
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	45 829	40 399	34 707	31 690	31 367
Nombre de parts en circulation**	2 325 778	2 371 807	2 240 598	2 375 263	2 196 139
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,95	2,96	2,96	3,46	3,47
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,95	2,96	2,96	4,22	4,22
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,95	2,95	2,96	2,96	2,96
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,95	2,95	2,95	2,95	2,96
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,87	2,88	2,91	3,44	3,43
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,93	2,93	2,93	3,98	4,00
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,02	0,03	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,95	2,96	2,96	2,97	2,97
Taux de rotation des titres en portefeuille	16,47	26,87	11,45	24,30	19,70
Stratégie 100% actions					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,94	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,94	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,94	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,94	-	-	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Stratégie 100% actions (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe G	10,94	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,13	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,13	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	11,13	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,94	-	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	51	-	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	4 621	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,11	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,11	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,12	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,11	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,11	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,11	-	-	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	2,61	-	-	-	-
Celestia sécuritaire					
Valeur liquidative par part, Classe A	14,51	13,64	13,13	12,07	12,60
Valeur liquidative par part, Classe B	14,11	13,26	12,77	11,74	12,37
Valeur liquidative par part, Classe C	14,62	13,74	13,23	12,16	12,67
Valeur liquidative par part, Classe E	14,62	13,74	13,23	12,16	12,67
Valeur liquidative par part, Classe F	14,54	13,67	13,16	12,09	12,62
Valeur liquidative par part, Classe G	14,43	13,56	13,05	11,99	12,55
Valeur liquidative par part, Classe I	17,38	15,88	14,87	13,28	13,45
Valeur liquidative par part, Classe J	17,44	15,94	14,92	13,34	13,51
Valeur liquidative par part, Classe N	14,62	13,74	13,23	12,16	12,67
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	75 421	79 317	87 543	87 624	95 586
Nombre de parts en circulation**	5 171 318	5 790 729	6 637 993	7 231 054	7 547 968
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,85	2,85	2,85	3,10	3,10
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,85	2,85	2,85	3,98	3,98
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,84	2,85	2,85	2,85	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,84	2,85	2,85	2,86	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,81	2,81	2,84	3,05	3,04
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,80	2,81	2,83	3,29	3,29
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,03	0,03	0,04	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,03	0,03	0,04	0,04	0,04
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,85	2,85	2,85	2,86	2,86
Taux de rotation des titres en portefeuille	4,98	11,78	1,85	20,71	14,21
Celestia équilibré					
Valeur liquidative par part, Classe A	15,46	13,86	13,69	12,31	13,10
Valeur liquidative par part, Classe B	15,13	13,57	13,41	12,06	12,91

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Celestia équilibré (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe C	15,68	14,06	13,89	12,49	13,22
Valeur liquidative par part, Classe E	15,68	14,06	13,89	12,49	13,23
Valeur liquidative par part, Classe F	15,54	13,92	13,75	12,36	13,13
Valeur liquidative par part, Classe G	15,33	13,74	13,58	12,21	13,02
Valeur liquidative par part, Classe I	18,72	16,30	15,65	13,67	14,06
Valeur liquidative par part, Classe J	18,82	16,39	15,74	13,75	14,14
Valeur liquidative par part, Classe N	15,67	14,05	13,89	12,49	13,22
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	110 881	110 701	131 759	130 032	144 408
Nombre de parts en circulation**	7 080 505	7 900 879	9 520 679	10 464 717	10 963 779
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,96	2,97	2,97	3,43	3,43
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,96	2,97	2,97	4,10	4,10
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,96	2,97	2,97	2,97	2,98
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,96	2,97	2,97	2,97	2,97
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,91	2,93	2,95	3,30	3,30
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,94	2,95	2,95	3,70	3,70
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,06	0,09	0,09	0,10	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,06	0,09	0,09	0,10	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,97	2,97	2,98	2,98	2,98
Taux de rotation des titres en portefeuille	11,28	10,98	2,42	12,90	9,65
Celestia croissance					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,63	14,42	14,48	12,82	13,81
Valeur liquidative par part, Classe B	16,33	14,15	14,21	12,58	13,63
Valeur liquidative par part, Classe C	16,90	14,66	14,72	13,03	13,96
Valeur liquidative par part, Classe E	16,92	14,67	14,73	13,04	13,97
Valeur liquidative par part, Classe F	16,70	14,47	14,53	12,86	13,83
Valeur liquidative par part, Classe G	16,43	14,25	14,31	12,66	13,69
Valeur liquidative par part, Classe I	20,23	17,04	16,61	14,29	14,86
Valeur liquidative par part, Classe J	20,37	17,15	16,73	14,38	14,96
Valeur liquidative par part, Classe N	16,90	14,65	14,72	13,03	13,96
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	45 526	40 641	50 186	46 765	56 600
Nombre de parts en circulation**	2 703 739	2 784 875	3 424 953	3 606 986	4 070 991
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,03	3,03	3,04	3,54	3,55
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,00	3,01	3,02	4,16	4,16
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,02	3,03	3,03	3,04	3,04
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,01	3,01	3,02	3,02	3,02
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,96	2,99	3,00	3,46	3,46
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,01	3,01	3,02	3,96	3,94
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,07	0,11	0,11	0,12	0,12
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,07	0,11	0,11	0,12	0,12
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,03	3,04	3,04	3,04	3,04
Taux de rotation des titres en portefeuille	24,08	11,13	2,41	9,16	8,43

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Celestia audacieux					
Valeur liquidative par part, Classe A	17,28	14,53	14,73	12,85	14,00
Valeur liquidative par part, Classe B	16,85	14,18	14,37	12,55	13,77
Valeur liquidative par part, Classe C	17,53	14,75	14,95	13,05	14,14
Valeur liquidative par part, Classe D	16,85	14,18	14,38	12,55	13,77
Valeur liquidative par part, Classe E	17,56	14,77	14,98	13,07	14,15
Valeur liquidative par part, Classe F	17,24	14,50	14,70	12,82	13,97
Valeur liquidative par part, Classe G	16,84	14,17	14,36	12,53	13,76
Valeur liquidative par part, Classe H	16,46	13,85	14,04	12,25	13,55
Valeur liquidative par part, Classe I	21,05	17,19	16,91	14,33	15,07
Valeur liquidative par part, Classe J	21,21	17,32	17,05	14,44	15,19
Valeur liquidative par part, Classe N	17,53	14,75	14,95	13,05	14,14
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	32 218	31 024	32 624	31 764	37 840
Nombre de parts en circulation**	1 851 206	2 124 566	2 213 418	2 464 165	2 695 274
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,06	3,06	3,08	3,58	3,58
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,09	3,09	3,10	4,35	4,35
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,09	3,09	3,10	3,10	3,10
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,08	3,09	3,09	4,35	4,35
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,06	3,07	3,07	3,07	3,06
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,06	3,06	3,07	3,67	3,66
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,07	3,07	3,07	4,38	4,38
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,09	3,09	3,10	5,10	5,10
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,08	0,12	0,12	0,13	0,13
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,08	0,12	0,12	0,13	0,13
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,09	3,09	3,10	3,10	3,10
Taux de rotation des titres en portefeuille	21,25	22,41	3,18	3,34	10,47
Célestia 100% actions					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,83	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,83	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,83	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,83	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,83	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,01	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,01	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,83	-	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	292	-	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	26 979	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,20	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,19	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,21	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,19	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,20	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	-	-	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Célestia 100% actions (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,20	-	-	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	2,51	-	-	-	-
Revenu sécuritaire Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,68	10,11	9,57	9,10	9,78
Valeur liquidative par part, Classe B	10,26	9,71	9,18	8,75	9,53
Valeur liquidative par part, Classe C	10,79	10,22	9,67	9,19	9,85
Valeur liquidative par part, Classe E	10,81	10,23	9,67	9,19	9,85
Valeur liquidative par part, Classe F	10,71	10,14	9,59	9,11	9,79
Valeur liquidative par part, Classe G	10,60	10,03	9,49	9,02	9,72
Valeur liquidative par part, Classe I	12,92	11,90	10,95	10,09	10,49
Valeur liquidative par part, Classe J	14,96	13,78	12,68	11,33	11,38
Valeur liquidative par part, Classe L	15,23	14,02	12,90	11,53	11,58
Valeur liquidative par part, Classe N	10,80	10,22	9,67	9,19	9,85
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	24 518	25 442	27 194	22 052	18 778
Nombre de parts en circulation**	2 256 690	2 480 190	2 807 219	2 398 512	1 902 123
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,94	2,94	2,95	3,25	3,25
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,93	2,94	2,95	4,44	4,45
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,94	2,94	2,95	2,94	2,95
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,92	2,92	2,93	2,92	2,94
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,90	2,90	2,91	3,20	3,22
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,89	2,89	2,90	3,48	3,49
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,18	0,18	0,19	0,18	0,19
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,18	0,18	0,19	0,18	0,19
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,18	0,18	0,19	0,18	0,19
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,94	2,94	2,95	2,93	2,94
Taux de rotation des titres en portefeuille	5,12	5,08	6,07	5,41	3,47
Revenu Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,42	10,31	9,85	9,17	10,01
Valeur liquidative par part, Classe B	11,02	9,94	9,49	8,85	9,77
Valeur liquidative par part, Classe C	11,62	10,49	10,02	9,33	10,12
Valeur liquidative par part, Classe E	11,64	10,51	10,04	9,34	10,13
Valeur liquidative par part, Classe F	11,49	10,37	9,90	9,22	10,04
Valeur liquidative par part, Classe G	11,29	10,19	9,73	9,06	9,92
Valeur liquidative par part, Classe I	13,93	12,23	11,36	10,25	10,77
Valeur liquidative par part, Classe J	16,12	14,15	13,15	11,51	11,70
Valeur liquidative par part, Classe L	16,44	14,43	13,41	11,74	11,93
Valeur liquidative par part, Classe N	11,73	10,59	10,12	9,41	10,21
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	31 524	32 769	38 206	36 993	33 945
Nombre de parts en circulation**	2 698 958	3 115 660	3 807 764	3 966 398	3 355 391
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,02	3,02	3,02	3,54	3,54
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,92	3,00	3,01	4,61	4,60

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Revenu Guardian (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,98	3,02	3,04	3,04	3,05
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,99	3,00	2,99	2,98	3,01
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,98	2,99	2,98	3,39	3,40
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,96	2,97	2,97	3,90	3,91
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,21	0,22	0,22	0,22	0,23
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,21	0,22	0,22	0,22	0,23
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,21	0,22	0,22	0,22	0,23
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,03	3,04	3,04	3,04	3,05
Taux de rotation des titres en portefeuille	4,57	5,23	10,31	2,90	3,54
Répartition d'actifs canadiens CI Cambridge					
Valeur liquidative par part, Classe A	8,21	7,52	7,38	6,87	7,59
Valeur liquidative par part, Classe B	8,03	7,35	7,22	6,73	7,49
Valeur liquidative par part, Classe C	8,35	7,65	7,50	6,99	7,68
Valeur liquidative par part, Classe E	8,38	7,67	7,52	7,00	7,68
Valeur liquidative par part, Classe F	8,21	7,51	7,36	6,85	7,58
Valeur liquidative par part, Classe G	7,99	7,31	7,16	6,68	7,45
Valeur liquidative par part, Classe I	10,02	8,92	8,51	7,68	8,17
Valeur liquidative par part, Classe J	11,71	10,43	9,95	8,68	8,90
Valeur liquidative par part, Classe L	16,83	14,98	14,30	12,47	12,79
Valeur liquidative par part, Classe N	8,35	7,64	7,50	6,99	7,68
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	74 520	77 386	93 422	101 338	137 580
Nombre de parts en circulation**	8 715 978	9 933 041	12 210 704	14 303 347	17 593 365
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,98	2,96	2,96	3,48	3,48
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,98	2,96	2,96	4,10	4,10
Ratio des frais de gestion, Classe C	2,98	2,96	2,96	2,98	2,98
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,93	2,90	2,91	2,93	2,93
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,88	2,86	2,86	3,57	3,56
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,89	2,88	2,89	4,32	4,32
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,17	0,15	0,15	0,17	0,17
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,17	0,15	0,15	0,17	0,17
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,17	0,15	0,15	0,17	0,17
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,99	2,97	2,97	2,99	2,99
Taux de rotation des titres en portefeuille	-	-	-	0,08	3,77
Revenu et croissance mondial CI Signature					
Valeur liquidative par part, Classe A	8,00	7,10	6,37	5,99	6,50
Valeur liquidative par part, Classe B	7,80	6,92	6,20	5,84	6,39
Valeur liquidative par part, Classe C	8,14	7,23	6,48	6,09	6,57
Valeur liquidative par part, Classe E	8,17	7,25	6,49	6,10	6,58
Valeur liquidative par part, Classe F	7,98	7,08	6,34	5,96	6,48
Valeur liquidative par part, Classe G	7,76	6,89	6,17	5,81	6,37
Valeur liquidative par part, Classe I	10,04	8,64	7,49	6,79	7,06
Valeur liquidative par part, Classe J	12,07	10,38	9,01	7,86	7,84

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Revenu et croissance mondial CI Signature (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe L	21,93	18,85	16,36	14,27	14,24
Valeur liquidative par part, Classe N	8,14	7,22	6,47	6,09	6,57
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	235 055	194 770	181 364	168 751	132 614
Nombre de parts en circulation**	26 970 930	25 290 513	26 575 671	26 629 853	19 328 502
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,20	3,20	3,20	3,70	3,70
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,21	3,21	3,21	4,43	4,43
Ratio des frais de gestion, Classe C	3,20	3,21	3,21	3,21	3,21
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,17	3,17	3,17	3,17	3,16
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,14	3,13	3,13	3,87	3,84
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,14	3,15	3,15	4,60	4,60
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,22	3,22	3,22	3,22	3,22
Taux de rotation des titres en portefeuille	1,84	5,85	4,66	1,51	8,23
Actions canadiennes dividendes Guardian					
Valeur liquidative par part, Classe A	16,57	13,07	14,32	12,19	14,01
Valeur liquidative par part, Classe B	16,11	12,71	13,92	11,85	13,75
Valeur liquidative par part, Classe E	16,87	13,30	14,57	12,40	14,17
Valeur liquidative par part, Classe F	16,50	13,00	14,23	12,10	13,93
Valeur liquidative par part, Classe G	16,17	12,73	13,93	11,84	13,73
Valeur liquidative par part, Classe I	19,80	15,21	16,24	13,46	14,99
Valeur liquidative par part, Classe J	19,80	15,21	16,24	13,46	14,99
Valeur liquidative par part, Classe L	16,47	12,65	13,50	11,20	12,47
Valeur liquidative par part, Classe N	16,83	13,28	14,55	12,39	14,16
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	67 154	62 166	63 291	70 214	87 215
Nombre de parts en circulation**	3 856 937	4 574 994	4 409 072	5 805 961	6 276 330
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,84	2,84	2,84	3,35	3,36
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,84	2,84	2,84	4,25	4,26
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,80	2,80	2,80	2,83	2,85
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,74	2,73	2,72	3,58	3,62
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,67	2,66	2,67	4,25	4,28
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,20	0,20	0,20	0,21	0,22
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,20	0,20	0,20	0,21	0,22
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,20	0,20	0,20	0,21	0,22
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,84	2,84	2,84	2,85	2,86
Taux de rotation des titres en portefeuille	3,40	21,75	0,85	1,69	8,60
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée					
Valeur liquidative par part, Classe A	32,80	27,07	26,60	22,71	25,05
Valeur liquidative par part, Classe B	31,70	26,16	25,71	21,95	24,48
Valeur liquidative par part, Classe D	31,70	26,16	25,71	21,95	24,48
Valeur liquidative par part, Classe E	33,35	27,52	27,04	23,08	25,33

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions canadiennes valeur Jarislowsky Fraser Limitée (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe F	32,55	26,85	26,38	22,51	24,91
Valeur liquidative par part, Classe G	31,78	26,22	25,76	21,98	24,51
Valeur liquidative par part, Classe H	30,80	25,41	24,97	21,32	24,00
Valeur liquidative par part, Classe I	39,62	31,79	30,37	25,20	26,90
Valeur liquidative par part, Classe J	39,62	31,79	30,37	25,20	26,90
Valeur liquidative par part, Classe N	33,33	27,50	27,03	23,07	25,33
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	250 138	249 410	222 003	194 152	180 963
Nombre de parts en circulation**	6 729 673	8 220 911	7 674 666	8 044 759	6 994 960
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,82	2,82	2,82	3,31	3,31
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,82	2,82	2,82	4,40	4,40
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,82	2,82	2,82	4,40	4,40
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,81	2,80	2,81	2,81	2,80
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,79	2,79	2,80	3,60	3,59
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,80	2,79	2,79	4,34	4,34
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,82	2,82	2,82	5,32	5,32
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,01	-	0,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,01	-	0,01	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,82	2,82	2,82	2,82	2,81
Taux de rotation des titres en portefeuille	1,99	8,80	3,93	7,23	7,79
Actions canadiennes Triasima					
Valeur liquidative par part, Classe A	21,67	17,55	16,83	13,94	16,62
Valeur liquidative par part, Classe B	21,02	17,02	16,32	13,52	16,27
Valeur liquidative par part, Classe D	20,96	16,97	16,27	13,48	16,24
Valeur liquidative par part, Classe E	22,03	17,84	17,10	14,17	16,80
Valeur liquidative par part, Classe F	21,59	17,47	16,73	13,85	16,54
Valeur liquidative par part, Classe G	21,05	17,03	16,31	13,51	16,26
Valeur liquidative par part, Classe H	20,36	16,48	15,80	13,09	15,92
Valeur liquidative par part, Classe I	26,18	20,61	19,21	15,48	17,84
Valeur liquidative par part, Classe J	26,18	20,61	19,21	15,48	17,84
Valeur liquidative par part, Classe K	26,18	20,61	19,21	15,48	17,84
Valeur liquidative par part, Classe L	15,92	12,54	11,69	9,41	-
Valeur liquidative par part, Classe N	22,02	17,83	17,09	14,16	16,80
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	312 617	301 895	302 679	265 151	260 472
Nombre de parts en circulation**	12 353 479	14 980 113	16 054 351	17 402 419	14 780 810
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,81	2,81	2,81	3,31	3,31
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,80	2,80	2,81	4,29	4,29
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,79	2,80	2,80	4,38	4,39
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,80	2,80	2,80	2,81	2,81
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,72	2,72	2,73	3,53	3,53
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,71	2,72	2,73	4,32	4,32
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,81	2,81	2,81	5,31	5,31
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions canadiennes Triasima (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,81	2,81	2,81	2,81	2,81
Taux de rotation des titres en portefeuille	57,96	90,19	61,55	92,30	78,22
Indice canadien BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe A	18,73	15,39	14,97	12,52	14,19
Valeur liquidative par part, Classe B	18,08	14,86	14,46	12,09	13,85
Valeur liquidative par part, Classe D	18,28	15,02	14,61	12,22	13,95
Valeur liquidative par part, Classe E	19,04	15,64	15,22	12,73	14,34
Valeur liquidative par part, Classe F	18,59	15,27	14,85	12,42	14,10
Valeur liquidative par part, Classe G	18,11	14,87	14,47	12,10	13,86
Valeur liquidative par part, Classe H	17,59	14,45	14,06	11,76	13,59
Valeur liquidative par part, Classe I	22,54	18,02	17,05	13,88	15,21
Valeur liquidative par part, Classe J	22,66	18,11	17,14	13,95	15,29
Valeur liquidative par part, Classe N	19,02	15,63	15,21	12,72	14,34
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	12 977	13 862	15 766	18 900	22 305
Nombre de parts en circulation**	698 875	897 432	1 045 819	1 469 191	1 547 652
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,76	2,77	2,76	3,26	3,27
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,76	2,76	2,76	4,38	4,38
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,76	2,77	2,76	4,04	4,04
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,76	2,76	2,75	2,75	2,75
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,71	2,72	2,73	3,53	3,54
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,76	2,75	2,74	4,35	4,35
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,76	2,76	2,76	5,26	5,27
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,01	0,01	-	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,01	0,01	-	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,76	2,77	2,76	2,77	2,77
Taux de rotation des titres en portefeuille	14,54	4,12	7,90	6,86	10,50
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	27,15	22,19	19,11	15,34	18,06
Valeur liquidative par part, Classe B	25,94	21,20	18,26	14,66	17,51
Valeur liquidative par part, Classe E	27,62	22,58	19,44	15,60	18,27
Valeur liquidative par part, Classe F	26,93	22,00	18,93	15,18	17,93
Valeur liquidative par part, Classe G	26,22	21,42	18,44	14,80	17,63
Valeur liquidative par part, Classe I	33,25	26,37	22,03	17,15	19,49
Valeur liquidative par part, Classe J	33,25	26,37	22,03	17,15	19,49
Valeur liquidative par part, Classe N	27,58	22,54	19,41	15,58	18,25
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	27 164	19 651	17 647	16 593	24 094
Nombre de parts en circulation**	973 095	865 859	909 819	1 073 337	1 320 245
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,09	3,10	3,11	3,61	3,60
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,08	3,10	3,11	5,06	5,05

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions canadiennes à petite capitalisation Fiera Capital (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,07	3,08	3,09	3,08	3,07
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,01	3,03	3,03	3,94	3,93
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,05	3,06	3,07	4,78	4,76
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,06	0,07	0,07	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,06	0,07	0,07	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,09	3,10	3,12	3,12	3,10
Taux de rotation des titres en portefeuille	0,92	10,20	0,54	1,90	9,98
Actions américaines Hillsdale					
Valeur liquidative par part, Classe A	39,98	30,36	29,05	25,35	25,91
Valeur liquidative par part, Classe B	38,61	29,31	28,05	24,48	25,30
Valeur liquidative par part, Classe E	40,66	30,87	29,52	25,76	26,19
Valeur liquidative par part, Classe F	39,72	30,14	28,81	25,13	25,76
Valeur liquidative par part, Classe G	38,74	29,41	28,13	24,55	25,35
Valeur liquidative par part, Classe I	49,15	36,18	33,56	28,39	27,98
Valeur liquidative par part, Classe J	48,54	35,73	33,14	28,04	27,64
Valeur liquidative par part, Classe K	55,67	40,98	38,00	32,15	31,70
Valeur liquidative par part, Classe L	16,67	12,27	11,38	9,63	-
Valeur liquidative par part, Classe N	40,11	30,45	29,13	25,43	25,86
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	92 873	82 026	84 684	74 557	73 476
Nombre de parts en circulation**	1 966 121	2 303 539	2 547 531	2 549 573	2 521 722
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,13	3,11	3,14	3,65	3,66
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,13	3,11	3,14	4,77	4,78
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,11	3,07	3,13	3,14	3,16
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,07	3,04	3,09	3,91	3,93
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,11	3,09	3,13	4,66	4,71
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	-	0,04	0,05	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	-	0,04	0,05	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe K	0,02	-	0,04	0,05	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	-	0,04	0,05	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,13	3,11	3,14	3,15	3,16
Taux de rotation des titres en portefeuille	111,72	105,26	85,65	72,17	88,68
Actions américaines Beutel Goodman					
Valeur liquidative par part, Classe A	17,31	15,63	14,74	12,26	12,70
Valeur liquidative par part, Classe B	16,71	15,09	14,23	11,84	12,40
Valeur liquidative par part, Classe E	17,61	15,89	14,98	12,46	12,84
Valeur liquidative par part, Classe F	17,20	15,52	14,63	12,16	12,62
Valeur liquidative par part, Classe G	16,77	15,13	14,27	11,87	12,42
Valeur liquidative par part, Classe I	21,12	18,51	16,95	13,68	13,68
Valeur liquidative par part, Classe J	21,12	18,51	16,95	13,68	13,68
Valeur liquidative par part, Classe N	17,58	15,87	14,97	12,46	12,83
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	34 040	29 808	37 219	37 839	45 470
Nombre de parts en circulation**	1 941 573	1 903 910	2 524 064	3 085 131	3 580 054

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions américaines Beutel Goodman (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,06	3,06	3,06	3,55	3,60
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,06	3,06	3,06	4,67	4,72
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,03	3,02	3,03	3,04	3,09
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,00	2,98	2,98	3,78	3,87
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,02	3,03	3,03	4,58	4,64
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,07	0,07	0,07	0,07	0,11
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,07	0,07	0,07	0,07	0,11
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,06	3,06	3,06	3,06	3,09
Taux de rotation des titres en portefeuille	7,67	-	1,10	5,50	6,08
Actions américaines Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	24,09	18,66	16,07	12,92	12,20
Valeur liquidative par part, Classe B	23,27	18,04	15,53	12,48	11,92
Valeur liquidative par part, Classe D	23,45	18,18	15,66	12,58	11,98
Valeur liquidative par part, Classe E	24,48	18,97	16,33	13,13	12,33
Valeur liquidative par part, Classe F	23,93	18,53	15,95	12,81	12,13
Valeur liquidative par part, Classe G	23,33	18,08	15,57	12,51	11,94
Valeur liquidative par part, Classe H	22,61	17,52	15,09	12,13	11,69
Valeur liquidative par part, Classe I	29,28	22,04	18,43	14,39	13,13
Valeur liquidative par part, Classe J	29,29	22,05	18,44	14,39	13,13
Valeur liquidative par part, Classe N	24,46	18,96	16,33	13,12	12,33
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	154 091	104 261	78 095	56 895	44 832
Nombre de parts en circulation**	6 335 209	5 560 125	4 831 046	4 408 384	3 687 163
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,96	2,97	2,98	3,48	3,49
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,96	2,97	2,98	4,56	4,58
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,97	2,98	2,99	4,30	4,32
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,94	2,96	2,98	2,97	2,99
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,89	2,92	2,94	3,75	3,75
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,95	2,96	2,97	4,51	4,53
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,96	2,97	2,98	5,48	5,50
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,06	0,05	0,07
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,06	0,05	0,07
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,96	2,97	2,98	2,98	2,99
Taux de rotation des titres en portefeuille	1,52	9,33	2,48	3,11	3,67
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	23,30	17,96	15,30	11,79	12,21
Valeur liquidative par part, Classe B	22,74	17,53	14,93	11,51	12,06
Valeur liquidative par part, Classe E	23,57	18,16	15,47	11,92	12,28
Valeur liquidative par part, Classe F	23,20	17,86	15,21	11,72	12,17
Valeur liquidative par part, Classe G	22,90	17,64	15,01	11,55	12,07
Valeur liquidative par part, Classe I	27,41	20,51	16,96	12,69	12,70
Valeur liquidative par part, Classe J	27,41	20,51	16,96	12,69	12,70
Valeur liquidative par part, Classe N	23,52	18,13	15,45	11,91	12,28

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions américaines couvertes sur la devise Fiera Capital (suite)					
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	31 253	23 931	14 489	9 421	7 593
Nombre de parts en circulation**	1 310 555	1 288 708	933 316	787 479	615 679
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,02	3,03	3,05	3,53	3,58
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,05	3,06	3,07	4,68	4,70
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,00	3,01	3,02	3,00	3,08
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,94	2,97	3,01	3,82	3,88
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,98	2,91	2,89	4,41	4,63
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,06	0,07	0,08	0,08	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,06	0,07	0,08	0,08	0,10
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,05	3,06	3,07	3,07	3,08
Taux de rotation des titres en portefeuille	11,77	15,53	19,65	18,92	10,39
Indice américain BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe A	23,84	19,27	17,14	14,17	14,11
Valeur liquidative par part, Classe B	23,02	18,60	16,54	13,68	13,78
Valeur liquidative par part, Classe D	23,24	18,77	16,70	13,81	13,86
Valeur liquidative par part, Classe E	24,28	19,61	17,44	14,41	14,27
Valeur liquidative par part, Classe F	23,77	19,19	17,05	14,08	14,05
Valeur liquidative par part, Classe G	23,14	18,69	16,62	13,73	13,81
Valeur liquidative par part, Classe H	22,39	18,09	16,09	13,30	13,52
Valeur liquidative par part, Classe I	28,90	22,69	19,61	15,76	15,17
Valeur liquidative par part, Classe J	29,23	22,95	19,84	15,94	15,34
Valeur liquidative par part, Classe N	24,22	19,57	17,41	14,39	14,26
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	72 019	57 240	53 821	47 944	43 335
Nombre de parts en circulation**	2 928 202	2 909 302	3 093 584	3 351 429	3 057 923
Ratio des frais de gestion, Classe A	2,88	2,88	2,88	3,38	3,38
Ratio des frais de gestion, Classe B	2,87	2,88	2,88	4,50	4,50
Ratio des frais de gestion, Classe D	2,87	2,88	2,88	4,20	4,20
Ratio des frais de gestion, Classe E	2,84	2,84	2,84	2,84	2,84
Ratio des frais de gestion, Classe F	2,78	2,78	2,77	3,56	3,54
Ratio des frais de gestion, Classe G	2,85	2,83	2,83	4,37	4,37
Ratio des frais de gestion, Classe H	2,87	2,88	2,88	5,38	5,38
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	0,01	0,01	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	0,01	0,01	0,01	0,01
Ratio des frais de gestion, Classe N	2,88	2,88	2,89	2,88	2,88
Taux de rotation des titres en portefeuille	8,67	8,75	9,37	6,20	8,75
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,60	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,60	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,60	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,60	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,60	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,79	-	-	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions américaines à petite capitalisation ESG Fisher (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe J	11,09	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,60	-	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	11 674	-	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	1 055 031	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,54	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,51	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,54	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,53	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,51	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,15	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,15	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,51	-	-	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	0,68	-	-	-	-
Actions internationales GQG Partners					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,27	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,27	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,27	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,27	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,27	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,46	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,36	10,06	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,27	-	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	24 604	14 363	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	2 183 000	1 427 333	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,44	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,42	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,45	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,44	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,42	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,45	-	-	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	2,30	-	-	-	-
Actions internationales C WorldWide					
Valeur liquidative par part, Classe A	19,72	18,67	15,59	13,26	15,11
Valeur liquidative par part, Classe B	18,96	17,94	14,99	12,75	14,71
Valeur liquidative par part, Classe D	11,01	10,42	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	20,06	18,98	15,86	13,48	15,28
Valeur liquidative par part, Classe F	19,56	18,50	15,45	13,14	15,01
Valeur liquidative par part, Classe G	19,09	18,06	15,08	12,81	14,75
Valeur liquidative par part, Classe H	11,01	10,42	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	24,65	22,56	18,22	14,99	16,42

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions internationales C WorldWide (suite)					
Valeur liquidative par part, Classe J	24,65	22,56	18,22	14,99	16,42
Valeur liquidative par part, Classe K	24,65	22,56	18,22	14,99	16,42
Valeur liquidative par part, Classe L	16,37	14,98	12,10	9,95	-
Valeur liquidative par part, Classe N	20,01	18,94	15,83	13,47	15,27
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	231 106	197 193	164 715	136 718	127 952
Nombre de parts en circulation**	9 724 805	9 039 565	9 232 948	9 293 910	7 899 201
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,36	3,37	3,37	3,87	3,88
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,37	3,38	3,38	5,12	5,12
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,39	3,39	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,36	3,36	3,36	3,34	3,35
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,34	3,34	3,34	4,20	4,18
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,34	3,29	3,30	4,95	4,98
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,38	3,38	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe K	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,39	3,39	3,39	3,39	3,39
Taux de rotation des titres en portefeuille	19,81	19,30	27,26	28,54	27,37
Indice international BlackRock					
Valeur liquidative par part, Classe A	15,21	14,22	13,84	12,31	13,56
Valeur liquidative par part, Classe B	14,63	13,68	13,31	11,84	13,20
Valeur liquidative par part, Classe D	14,77	13,81	13,44	11,95	13,29
Valeur liquidative par part, Classe E	15,48	14,46	14,07	12,51	13,71
Valeur liquidative par part, Classe F	15,07	14,08	13,70	12,18	13,47
Valeur liquidative par part, Classe G	14,68	13,72	13,35	11,87	13,23
Valeur liquidative par part, Classe H	14,26	13,33	12,98	11,54	12,98
Valeur liquidative par part, Classe I	18,76	16,99	16,03	13,81	14,66
Valeur liquidative par part, Classe J	18,76	16,99	16,03	13,81	14,66
Valeur liquidative par part, Classe N	15,45	14,44	14,06	12,50	13,70
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	19 289	88 262	63 335	57 525	53 876
Nombre de parts en circulation**	1 120 789	5 307 161	4 057 826	4 261 945	3 717 800
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,18	3,17	3,18	3,67	3,68
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,17	3,17	3,17	4,91	4,91
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,18	3,18	3,18	4,60	4,60
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,14	3,13	3,14	3,16	3,17
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,16	3,16	3,16	4,01	3,98
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,15	3,15	3,15	4,82	4,83
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,18	3,18	3,18	5,72	5,72
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	0,02	0,02	0,02
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,18	3,18	3,18	3,18	3,17

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Indice international BlackRock (suite)					
Taux de rotation des titres en portefeuille	11,02	22,14	12,61	9,64	12,03
Actions mondiales dividendes TD					
Valeur liquidative par part, Classe A	15,30	13,45	14,28	12,76	13,36
Valeur liquidative par part, Classe B	14,66	12,87	13,65	12,19	12,95
Valeur liquidative par part, Classe E	15,56	13,68	14,52	12,96	13,51
Valeur liquidative par part, Classe F	15,25	13,40	14,20	12,67	13,31
Valeur liquidative par part, Classe G	14,82	13,02	13,82	12,34	13,06
Valeur liquidative par part, Classe I	19,00	16,17	16,61	14,36	14,49
Valeur liquidative par part, Classe J	19,00	16,17	16,61	14,36	14,49
Valeur liquidative par part, Classe L	15,49	13,18	13,55	11,71	11,81
Valeur liquidative par part, Classe N	15,53	13,66	14,50	12,95	13,50
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	29 464	26 358	35 668	32 100	31 840
Nombre de parts en circulation**	1 812 062	1 884 604	2 388 528	2 446 029	2 346 765
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,30	3,29	3,30	3,79	3,79
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,17	3,20	3,21	5,21	5,24
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,27	3,26	3,27	3,26	3,28
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,17	3,18	3,19	3,99	4,00
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,25	3,24	3,24	4,85	4,85
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,02	0,02	0,02	0,02	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,02	0,02	0,02	0,02	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,02	0,02	0,02	0,02	0,03
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,30	3,30	3,30	3,30	3,31
Taux de rotation des titres en portefeuille	9,22	6,46	2,59	4,18	10,91
Actions mondiales Fiera Capital					
Valeur liquidative par part, Classe A	21,57	17,74	15,54	12,60	12,47
Valeur liquidative par part, Classe B	20,85	17,14	15,01	12,17	12,21
Valeur liquidative par part, Classe D	12,57	10,34	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	21,87	17,99	15,75	12,78	12,57
Valeur liquidative par part, Classe F	21,54	17,69	15,48	12,55	12,44
Valeur liquidative par part, Classe G	21,04	17,30	15,14	12,27	12,27
Valeur liquidative par part, Classe H	12,57	10,34	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	26,61	21,12	17,86	13,98	13,28
Valeur liquidative par part, Classe J	26,71	21,20	17,92	14,03	13,33
Valeur liquidative par part, Classe L	18,70	14,84	12,54	9,82	-
Valeur liquidative par part, Classe N	21,86	17,98	15,75	12,78	12,57
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	283 542	205 378	177 181	85 828	67 029
Nombre de parts en circulation**	11 543 956	10 385 300	10 220 549	6 310 012	5 079 608
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,60	3,60	3,60	4,10	4,11
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,54	3,58	3,58	5,48	5,47
Ratio des frais de gestion, Classe D	3,61	3,61	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,59	3,59	3,58	3,59	3,57
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,49	3,50	3,50	4,32	4,28

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions mondiales Fiera Capital (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,54	3,54	3,52	5,15	5,14
Ratio des frais de gestion, Classe H	3,61	3,61	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,05	0,04	0,06	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,05	0,04	0,06	0,06
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,04	0,05	0,04	0,06	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,60	3,60	3,59	3,58	3,58
Taux de rotation des titres en portefeuille	10,44	18,95	10,23	2,47	16,29
Actions mondiales GQG Partners					
Valeur liquidative par part, Classe A	10,68	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	10,68	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	10,68	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	10,68	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	10,68	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	10,88	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,17	9,59	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	10,72	9,53	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	7 580	6 670	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	685 770	695 857	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,47	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,47	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,51	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,51	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,47	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,48	3,45	-	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	64,58	-	-	-	-
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher					
Valeur liquidative par part, Classe A	15,21	13,51	10,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	15,21	13,51	10,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	15,23	13,52	10,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	15,24	13,53	10,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe G	15,22	13,52	10,83	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	16,58	14,24	11,03	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	16,58	14,24	11,03	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	15,21	13,51	10,83	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	115 459	90 858	71 691	-	-
Nombre de parts en circulation**	7 084 898	6 440 611	6 518 954	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,43	3,45	3,49	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,43	3,45	3,49	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,39	3,41	3,45	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,36	3,38	3,43	-	-

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Actions mondiales à petite capitalisation Fisher (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,40	3,43	3,46	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,04	0,06	0,10	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,04	0,06	0,10	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,43	3,45	3,49	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	11,47	8,23	-	-	-
Actions marchés émergents Fisher					
Valeur liquidative par part, Classe A	13,95	16,32	13,29	11,93	14,11
Valeur liquidative par part, Classe B	13,14	15,38	12,52	11,24	13,56
Valeur liquidative par part, Classe E	14,20	16,61	13,52	12,14	14,29
Valeur liquidative par part, Classe F	13,85	16,18	13,16	11,80	14,02
Valeur liquidative par part, Classe G	13,46	15,75	12,81	11,50	13,77
Valeur liquidative par part, Classe I	18,01	20,26	15,86	13,70	15,50
Valeur liquidative par part, Classe J	17,77	20,00	15,66	13,52	15,30
Valeur liquidative par part, Classe L	12,80	14,41	11,28	9,74	-
Valeur liquidative par part, Classe N	13,97	16,35	13,31	11,95	14,07
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	86 281	99 724	78 688	111 671	108 380
Nombre de parts en circulation**	5 024 907	5 108 783	5 103 804	8 338 227	7 121 601
Ratio des frais de gestion, Classe A	4,01	3,94	3,91	4,38	4,41
Ratio des frais de gestion, Classe B	4,01	3,94	3,91	6,30	6,29
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,99	3,91	3,89	3,86	3,79
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,85	3,82	3,80	4,78	4,57
Ratio des frais de gestion, Classe G	3,96	3,88	3,86	5,58	5,57
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,11	0,03	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,11	0,03	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,11	0,03	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	4,02	3,94	3,91	3,91	3,91
Taux de rotation des titres en portefeuille	14,81	10,49	5,55	3,54	12,45
Infrastructures mondiales Lazard					
Valeur liquidative par part, Classe A	18,10	15,53	17,03	14,29	15,36
Valeur liquidative par part, Classe B	17,69	15,15	16,60	13,91	15,07
Valeur liquidative par part, Classe E	18,44	15,81	17,33	14,54	15,53
Valeur liquidative par part, Classe F	17,97	15,39	16,86	14,13	15,24
Valeur liquidative par part, Classe I	22,74	18,84	19,97	16,19	16,72
Valeur liquidative par part, Classe J	22,73	18,83	19,96	16,18	16,71
Valeur liquidative par part, Classe L	13,60	11,27	11,94	9,68	-
Valeur liquidative par part, Classe N	18,38	15,77	17,30	14,52	15,52
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	119 220	80 083	96 740	106 217	123 184
Nombre de parts en circulation**	5 681 435	4 659 913	5 189 680	6 762 945	7 510 304
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,49	3,49	3,50	3,98	3,98
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,34	3,34	3,37	4,83	4,85
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,45	3,43	3,44	3,44	3,46
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,34	3,34	3,36	4,35	4,36

FONDS SSQ

ANNEXE – INFORMATIONS FINANCIÈRES (non audités)

Pour les exercices terminés les 31 décembre

	2021	2020	2019	2018	2017
	31 décembre				
Fonds SSQ					
Infrastructures mondiales Lazard (suite)					
Ratio des frais de gestion, Classe I	0,05	0,05	0,06	0,04	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe J	0,05	0,05	0,06	0,04	0,05
Ratio des frais de gestion, Classe L	0,05	0,05	0,06	0,04	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,49	3,49	3,50	3,49	3,50
Taux de rotation des titres en portefeuille	6,39	10,06	18,00	13,25	13,73
Immobilier mondial CI					
Valeur liquidative par part, Classe A	11,34	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe B	11,34	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe E	11,34	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe F	11,35	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe I	11,56	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe J	11,56	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe L	11,56	-	-	-	-
Valeur liquidative par part, Classe N	11,34	-	-	-	-
Actif net détenu pour le compte des souscripteurs	6 759	-	-	-	-
Nombre de parts en circulation**	592 729	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe A	3,56	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe B	3,54	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe E	3,49	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe F	3,41	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe I	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe J	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe L	-	-	-	-	-
Ratio des frais de gestion, Classe N	3,56	-	-	-	-
Taux de rotation des titres en portefeuille	26,03	-	-	-	-

**Nombre de parts total du Fonds

Bureau des ventes – Québec

Tél. : 1 888 292-8483

**Bureau des ventes – Ontario
Ouest du Canada et Maritimes**

Tél. : 1 888 429-2543

Service à la clientèle

2515, boulevard Laurier
C.P. 10510, succ. Sainte-Foy
Québec (Québec) G1V 0A3

Tél. : 1 800 320-4887
Télééc. : 1 866 559-6871

service.inv@ssq.ca

ssq.ca

