

Edgar Filing: HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC. - Form NSAR-A

HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC.

Form NSAR-A

July 29, 2009

PAGE 1
000 A000000 05/31/2009
000 C000000 0001173788
000 D000000 N
000 E000000 NF
000 F000000 Y
000 G000000 N
000 H000000 N
000 I000000 6.1
000 J000000 A
001 A000000 HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC.
001 B000000 811-21102
001 C000000 2125498400
002 A000000 THREE WORLD FIN CTR 200 VESEY ST 10TH FL
002 B000000 NEW YORK
002 C000000 NY
002 D010000 10281
002 D020000 1010
003 000000 N
004 000000 N
005 000000 N
006 000000 N
007 A000000 N
007 B000000 0
007 C010100 1
008 A000001 HYPERION BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT, INC.
008 B000001 A
008 C000001 801-34605
008 D010001 NEW YORK
008 D020001 NY
008 D030001 10281
008 D040001 1010
010 A000001 HYPERION BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT, INC.
010 B000001 801-34605
010 C010001 NEW YORK
010 C020001 NY
010 C030001 10281
010 C040001 1010
012 A000001 AMERICAN STOCK TRANSFER & TRUST CO.
012 B000001 85-19250
012 C010001 NEW YORK
012 C020001 NY
012 C030001 10038
013 A000001 BRIGGS, BUNTING & DOUGHERTY, LLP
013 B010001 PHILADELPHIA
013 B020001 PA
013 B030001 19103
015 A000001 STATE STREET BANK AND TRUST COMPANY
015 B000001 C
015 C010001 BOSTON
015 C020001 MA
015 C030001 02116
PAGE 2
015 E010001 X
018 000000 Y
019 A000000 Y
019 B000000 11
019 C000000 HYPERIONXX
020 A000001 HSBC SECURITIES, INC.

Edgar Filing: HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC. - Form NSAR-A

020	B000001	13-2650272	
020	C000001		1
021	000000		1
023	C000000		0
023	D000000		0
024	000000	N	
026	A000000	N	
026	B000000	N	
026	C000000	N	
026	D000000	Y	
026	E000000	Y	
026	F000000	N	
026	G010000	N	
026	G020000	N	
026	H000000	N	
027	000000	N	
028	A010000		0
028	A020000		0
028	A030000		0
028	A040000		0
028	B010000		0
028	B020000		0
028	B030000		0
028	B040000		0
028	C010000		0
028	C020000		0
028	C030000		0
028	C040000		0
028	D010000		0
028	D020000		0
028	D030000		0
028	D040000		0
028	E010000		0
028	E020000		0
028	E030000		0
028	E040000		0
028	F010000		0
028	F020000		0
028	F030000		0
028	F040000		0
028	G010000		0
028	G020000		0
028	G030000		0
028	G040000		0
028	H000000		0
	PAGE	3	
030	A000000		0
030	B000000		0.00
030	C000000		0.00
031	A000000		0
031	B000000		0
032	000000		0
033	000000		0
035	000000		0
036	B000000		0
038	000000		0
042	A000000		0
042	B000000		0
042	C000000		0
042	D000000		0
042	E000000		0
042	F000000		0

Edgar Filing: HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC. - Form NSAR-A

042 G000000 0
 042 H000000 0
 043 000000 0
 044 000000 0
 045 000000 Y
 046 000000 N
 047 000000 Y
 048 000000 0.650
 048 A010000 0
 048 A020000 0.000
 048 B010000 0
 048 B020000 0.000
 048 C010000 0
 048 C020000 0.000
 048 D010000 0
 048 D020000 0.000
 048 E010000 0
 048 E020000 0.000
 048 F010000 0
 048 F020000 0.000
 048 G010000 0
 048 G020000 0.000
 048 H010000 0
 048 H020000 0.000
 048 I010000 0
 048 I020000 0.000
 048 J010000 0
 048 J020000 0.000
 048 K010000 0
 048 K020000 0.000
 049 000000 N
 050 000000 N
 051 000000 N
 052 000000 N
 053 A000000 N
 PAGE 4
 054 A000000 Y
 054 B000000 Y
 054 C000000 N
 054 D000000 N
 054 E000000 N
 054 F000000 N
 054 G000000 N
 054 H000000 Y
 054 I000000 N
 054 J000000 Y
 054 K000000 N
 054 L000000 N
 054 M000000 Y
 054 N000000 N
 054 O000000 N
 055 A000000 N
 055 B000000 N
 056 000000 Y
 057 000000 N
 058 A000000 N
 059 000000 Y
 060 A000000 Y
 060 B000000 Y
 061 000000 0
 062 A000000 Y
 062 B000000 0.0

Edgar Filing: HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC. - Form NSAR-A

062	C000000	0.0
062	D000000	0.0
062	E000000	0.0
062	F000000	0.0
062	G000000	0.0
062	H000000	0.0
062	I000000	0.0
062	J000000	0.0
062	K000000	0.0
062	L000000	0.0
062	M000000	17.8
062	N000000	52.0
062	O000000	0.0
062	P000000	0.0
062	Q000000	60.8
062	R000000	0.0
063	A000000	0
063	B000000	4.8
064	A000000	N
064	B000000	N
066	A000000	N
067	000000	N
068	A000000	N
068	B000000	N
069	000000	N
	PAGE	5
070	A010000	Y
070	A020000	Y
070	B010000	N
070	B020000	N
070	C010000	Y
070	C020000	N
070	D010000	N
070	D020000	N
070	E010000	Y
070	E020000	Y
070	F010000	N
070	F020000	N
070	G010000	Y
070	G020000	N
070	H010000	N
070	H020000	N
070	I010000	N
070	I020000	N
070	J010000	Y
070	J020000	Y
070	K010000	Y
070	K020000	N
070	L010000	Y
070	L020000	N
070	M010000	N
070	M020000	N
070	N010000	Y
070	N020000	N
070	O010000	Y
070	O020000	Y
070	P010000	Y
070	P020000	N
070	Q010000	N
070	Q020000	N
070	R010000	Y
070	R020000	Y

Edgar Filing: HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC. - Form NSAR-A

071 A000000	10950
071 B000000	25545
071 C000000	77846
071 D000000	14
072 A000000	6
072 B000000	3513
072 C000000	0
072 D000000	0
072 E000000	0
072 F000000	190
072 G000000	62
072 H000000	0
072 I000000	13
072 J000000	27
072 K000000	0
PAGE 6	
072 L000000	30
072 M000000	40
072 N000000	13
072 O000000	0
072 P000000	6
072 Q000000	0
072 R000000	31
072 S000000	19
072 T000000	0
072 U000000	0
072 V000000	0
072 W000000	84
072 X000000	515
072 Y000000	0
072 Z000000	2998
072AA000000	0
072BB000000	13185
072CC010000	11135
072CC020000	0
072DD010000	4411
072DD020000	0
072EE000000	0
073 A010000	0.4400
073 A020000	0.0000
073 B000000	0.0000
073 C000000	0.0000
074 A000000	2370
074 B000000	0
074 C000000	0
074 D000000	74374
074 E000000	0
074 F000000	0
074 G000000	0
074 H000000	0
074 I000000	0
074 J000000	0
074 K000000	0
074 L000000	499
074 M000000	13
074 N000000	77256
074 O000000	2538
074 P000000	41
074 Q000000	0
074 R010000	4326
074 R020000	0
074 R030000	0

Edgar Filing: HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC. - Form NSAR-A

074 R040000 13420
074 S000000 0
074 T000000 56931
074 U010000 10145
074 U020000 0

PAGE 7

074 V010000 5.61
074 V020000 0.00
074 W000000 0.0000
074 X000000 19
074 Y000000 20354
075 A000000 0
075 B000000 58643
076 000000 6.07

077 A000000 N
078 000000 N
080 C000000 0
081 B000000 0
082 B000000 0
083 B000000 0
084 B000000 0

086 A010000 0
086 A020000 0
086 B010000 0
086 B020000 0
086 C010000 0
086 C020000 0
086 D010000 0
086 D020000 0
086 E010000 0
086 E020000 0
086 F010000 0
086 F020000 0

087 A010000 COMMON STOCK
087 A020000 42327M109
087 A030000 HSM
088 A000000 N
088 B000000 N
088 C000000 N
088 D000000 N

SIGNATURE STEVEN M PIRES
TITLE TREASURER