

HELIOS STRATEGIC MORTGAGE INCOME FUND, INC.

Form NSAR-B

January 29, 2009

PAGE 1
000 B000000 11/30/2008
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 THE HYPERION BROOKFIELD STRATEGIC MORTGAGE IN
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-B

020	B000001	13-2650272	
020	C000001	7	
021	000000	7	
022	A000001	MERRILL LYNCH	
022	B000001	13-5674085	
022	C000001	84904	
022	D000001	0	
022	A000002	PERSHING LLC	
022	B000002	13-2741729	
022	C000002	10899	
022	D000002	0	
022	A000003	CREDIT SUISSE SECURITIES LLC (USA)	
022	B000003	13-5659485	
022	C000003	2000	
022	D000003	0	
023	C000000	97803	
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	
	PAGE	3	
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	
030	A000000	0	
030	B000000	0.00	
030	C000000	0.00	
031	A000000	0	

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

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
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
	PAGE	4
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
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

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

054 O000000 N
 055 A000000 Y
 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
 062 C000000 0.0
 062 D000000 5.5
 062 E000000 0.0
 062 F000000 0.0
 062 G000000 0.0
 062 H000000 0.0
 062 I000000 0.0
 062 J000000 9.4
 062 K000000 0.0
 062 L000000 0.0
 062 M000000 26.9
 062 N000000 46.5
 062 O000000 0.0
 PAGE 5
 062 P000000 0.0
 062 Q000000 67.2
 062 R000000 0.0
 063 A000000 0
 063 B000000 4.5
 064 A000000 N
 064 B000000 N
 066 A000000 N
 067 000000 N
 068 A000000 N
 068 B000000 N
 069 000000 N
 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

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

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	
071	A000000		26217
071	B000000		49245
071	C000000		123434
	PAGE	6	
071	D000000		21
072	A000000	12	
072	B000000		10297
072	C000000		0
072	D000000		0
072	E000000		0
072	F000000		590
072	G000000		189
072	H000000		0
072	I000000		29
072	J000000		74
072	K000000		0
072	L000000		73
072	M000000		84
072	N000000		28
072	O000000		0
072	P000000		634
072	Q000000		0
072	R000000		62
072	S000000		46
072	T000000		0
072	U000000		0
072	V000000		0
072	W000000		222
072	X000000		2031
072	Y000000		0
072	Z000000		8266
072AA	000000		0
072BB	000000		848
072CC	010000		0
072CC	020000		50312
072DD	010000		9639
072DD	020000		0
072EE	000000		0
073	A010000		0.9500
073	A020000		0.0000
073	B000000		0.0000
073	C000000		0.0800
074	A000000		96
074	B000000		3304
074	C000000		5657
074	D000000		84892
074	E000000		0
074	F000000		0
074	G000000		0
074	H000000		0

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

074	I000000	0
074	J000000	0
074	K000000	0
074	L000000	741
074	M000000	1203
PAGE 7		
074	N000000	95893
074	O000000	0
074	P000000	0
074	Q000000	0
074	R010000	10650
074	R020000	0
074	R030000	0
074	R040000	24895
074	S000000	0
074	T000000	60348
074	U010000	10137
074	U020000	0
074	V010000	5.95
074	V020000	0.00
074	W000000	0.0000
074	X000000	19
074	Y000000	37510
075	A000000	0
075	B000000	90713
076	000000	5.54
077	A000000	Y
077	B000000	Y
077	C000000	N
077	D000000	N
077	E000000	N
077	F000000	N
077	G000000	N
077	H000000	N
077	I000000	N
077	J000000	N
077	K000000	N
077	L000000	N
077	M000000	N
077	N000000	N
077	O000000	N
077	P000000	N
077	Q010000	N
077	Q020000	N
077	Q030000	N
078	000000	N
080	A000000	FEDERAL INSURANCE COMPANY
080	C000000	2625
081	A000000	Y
081	B000000	3
082	A000000	N
082	B000000	0
083	A000000	N
083	B000000	0
084	A000000	N
084	B000000	0
085	A000000	Y
PAGE 8		
085	B000000	N
086	A010000	0
086	A020000	0
086	B010000	0

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

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	44915C105
087	A030000	HSM
088	A000000	N
088	B000000	N
088	C000000	N
088	D000000	N
SIGNATURE	THOMAS DOODIAN	
TITLE	TREASURER	