

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
072	AA000000	0
072	BB000000	13185
072	CC010000	11135
072	CC020000	0
072	DD010000	4411
072	DD020000	0
072	EE000000	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	