

Edgar Filing: FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND - Form NSAR-B

FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND

Form NSAR-B

December 30, 2008

PAGE 1  
000 B000000 10/31/2008  
000 C000000 1323520  
000 D000000 N  
000 E000000 NF  
000 F000000 Y  
000 G000000 N  
000 H000000 N  
000 I000000 6.1  
000 J000000 A  
001 A000000 FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND  
001 B000000 811-21756  
001 C000000 6307658000  
002 A000000 120 E. Liberty Drive Suite 400  
002 B000000 Wheaton  
002 C000000 IL  
002 D010000 60187  
003 000000 N  
004 000000 N  
005 000000 N  
006 000000 N  
007 A000000 N  
007 B000000 0  
007 C010100 1  
008 A000001 FIRST TRUST ADVISORS L.P.  
008 B000001 A  
008 C000001 801-39950  
008 D010001 Wheaton  
008 D020001 IL  
008 D030001 60187  
008 A000002 VALHALLA CAPITAL PARTNERS, LLC  
008 B000002 S  
008 C000002 801-64440  
008 D010002 Prospect  
008 D020002 KY  
008 D030002 40059  
010 A000001 PNC GLOBAL INVESTMENT SERVICING (U.S.) INC.  
010 B000001 84-01761  
010 C010001 WESTBOROUGH  
010 C020001 MA  
010 C030001 01581  
011 A000001 RBC CAPITAL MARKETS CORPORATION  
011 B000001 8-001672  
011 C010001 NEW YORK  
011 C020001 NY  
011 C030001 10006  
012 A000001 PNC GLOBAL INVESTMENT SERVICING (U.S.) INC.  
012 B000001 84-01761  
012 C010001 KING OF PRUSSIA  
012 C020001 PA  
012 C030001 19406  
013 A000001 DELOITTE & TOUCHE LLP  
PAGE 2  
013 B010001 CHICAGO  
013 B020001 IL  
013 B030001 60606  
013 B040001 4301  
015 A000001 PFPC TRUST COMPANY  
015 B000001 C

Edgar Filing: FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND - Form NSAR-B

015 C010001 PHILADELPHIA  
015 C020001 PA  
015 C030001 19153  
015 E010001 X  
018 000000 Y  
019 A000000 Y  
019 B000000 60  
019 C000000 FIRSTDEFIN  
021 000000 0  
022 A000001 JEFFRIES & CO  
022 B000001 95-2622900  
022 C000001 0  
022 D000001 15637  
022 A000002 SEAPORT GROUP  
022 B000002 00-0000000  
022 C000002 0  
022 D000002 10007  
022 A000003 R.W. BAIRD  
022 B000003 00-0000000  
022 C000003 0  
022 D000003 5612  
022 A000004 UCM, INC.  
022 B000004 54-1779870  
022 C000004 3571  
022 D000004 1872  
022 A000005 E.J. DELAROSA  
022 B000005 00-0000000  
022 C000005 0  
022 D000005 3540  
022 A000006 STIFEL, NICOLAUS & CO. INC.  
022 B000006 43-0538770  
022 C000006 1303  
022 D000006 0  
022 A000007 LEHMAN BROTHERS HOLDINGS  
022 B000007 13-3216325  
022 C000007 787  
022 D000007 0  
023 C000000 5661  
023 D000000 50524  
024 000000 N  
025 D000001 0  
026 A000000 N  
026 B000000 N  
026 C000000 N  
026 D000000 Y  
PAGE 3  
026 E000000 N  
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

Edgar Filing: FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND - Form NSAR-B

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
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
	PAGE	4
042	G000000	0
042	H000000	0
043	000000	0
044	000000	0
045	000000	Y
046	000000	N
047	000000	Y
048	000000	0.900
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

Edgar Filing: FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND - Form NSAR-B

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	Y
054	H000000	Y
054	I000000	N
054	J000000	Y
054	K000000	N
054	L000000	N
054	M000000	Y
054	N000000	Y
054	O000000	Y
055	A000000	N
	PAGE	5
055	B000000	Y
056	000000	Y
057	000000	N
058	A000000	N
059	000000	Y
060	A000000	Y
060	B000000	Y
061	000000	2000
062	A000000	Y
062	B000000	0.0
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	0.0
062	N000000	0.0
062	O000000	0.0
062	P000000	2.2
062	Q000000	93.3
062	R000000	2.3
063	A000000	0
063	B000000	22.1
064	A000000	N
064	B000000	Y
065	000000	N
066	A000000	N
067	000000	N
068	A000000	N
068	B000000	N
069	000000	N

Edgar Filing: FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND - Form NSAR-B

070 A010000 Y  
 070 A020000 N  
 070 B010000 Y  
 070 B020000 N  
 070 C010000 Y  
 070 C020000 N  
 070 D010000 Y  
 070 D020000 N  
 070 E010000 Y  
 070 E020000 N  
 070 F010000 Y  
 070 F020000 N  
 070 G010000 Y  
 070 G020000 N  
 070 H010000 Y

PAGE 6

070 H020000 N  
 070 I010000 Y  
 070 I020000 N  
 070 J010000 Y  
 070 J020000 Y  
 070 K010000 Y  
 070 K020000 N  
 070 L010000 Y  
 070 L020000 N  
 070 M010000 Y  
 070 M020000 N  
 070 N010000 Y  
 070 N020000 N  
 070 O010000 Y  
 070 O020000 Y  
 070 P010000 Y  
 070 P020000 N  
 070 Q010000 Y  
 070 Q020000 N  
 070 R010000 N  
 070 R020000 N

071 A000000 5661  
 071 B000000 54218  
 071 C000000 141933  
 071 D000000 4  
 072 A000000 12  
 072 B000000 22609  
 072 C000000 0  
 072 D000000 0  
 072 E000000 0  
 072 F000000 1254  
 072 G000000 138  
 072 H000000 0  
 072 I000000 43  
 072 J000000 16  
 072 K000000 0  
 072 L000000 65  
 072 M000000 39  
 072 N000000 0  
 072 O000000 313  
 072 P000000 2025  
 072 Q000000 0  
 072 R000000 82  
 072 S000000 14  
 072 T000000 0  
 072 U000000 0

Edgar Filing: FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND - Form NSAR-B

072 V000000 0  
 072 W000000 162  
 072 X000000 4151  
 072 Y000000 0  
 072 Z000000 18458

PAGE 7

072AA000000 0  
 072BB000000 54238  
 072CC010000 0  
 072CC020000 24268  
 072DD010000 7286  
 072DD020000 0  
 072EE000000 0  
 073 A010000 0.8100  
 073 A020000 0.0000  
 073 B000000 0.0000  
 073 C000000 1.1100  
 074 A000000 10086  
 074 B000000 0  
 074 C000000 0  
 074 D000000 56705  
 074 E000000 1389  
 074 F000000 0  
 074 G000000 0  
 074 H000000 0  
 074 I000000 0  
 074 J000000 5623  
 074 K000000 0  
 074 L000000 851  
 074 M000000 8  
 074 N000000 74662  
 074 O000000 0  
 074 P000000 71  
 074 Q000000 15000  
 074 R010000 0  
 074 R020000 0  
 074 R030000 0  
 074 R040000 210  
 074 S000000 0  
 074 T000000 59381  
 074 U010000 9036  
 074 U020000 0  
 074 V010000 6.57  
 074 V020000 0.00  
 074 W000000 0.0000  
 074 X000000 15  
 074 Y000000 0  
 075 A000000 0  
 075 B000000 96066  
 076 000000 6.34

077 A000000 Y  
 077 B000000 Y  
 077 C000000 N  
 077 D000000 Y  
 077 E000000 Y  
 077 F000000 N  
 077 G000000 N

PAGE 8

077 H000000 N  
 077 I000000 N  
 077 J000000 N  
 077 K000000 N

Edgar Filing: FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND - Form NSAR-B

077 L000000 N  
077 M000000 N  
077 N000000 N  
077 O000000 N  
077 P000000 N  
077 Q010000 N  
077 Q020000 Y  
077 Q030000 N  
078 000000 N  
080 A000000 ICI MUTUAL INSURANCE COMPANY  
080 B000000 N/A  
080 C000000 11200  
081 A000000 Y  
081 B000000 61  
082 A000000 N  
082 B000000 0  
083 A000000 N  
083 B000000 0  
084 A000000 N  
084 B000000 0  
085 A000000 Y  
085 B000000 Y  
086 A010000 52  
086 A020000 568  
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 337347108  
087 A030000 FHI  
088 A000000 Y  
088 B000000 N  
088 C000000 N  
088 D000000 N  
SIGNATURE JAMES M. DYKAS  
TITLE ASSISTANT TREASURER