

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

FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND

Form NSAR-A

June 29, 2009

PAGE 1  
000 A000000 04/30/2009  
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 84-1761  
012 C010001 WILMINGTON  
012 C020001 DE  
012 C030001 19809  
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-A

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	
023	C000000	0	
023	D000000	0	
024	000000	N	
026	A000000	N	
026	B000000	N	
026	C000000	N	
026	D000000	Y	
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	
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	
	PAGE	3	
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	

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

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	0.900
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
048	J010000	0
048	J020000	0.000
048	K010000	0
	PAGE	4
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
055	B000000	N
056	000000	Y
057	000000	N
058	A000000	N

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

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 18.0  
062 O000000 0.0  
062 P000000 2.9  
062 Q000000 72.2  
062 R000000 1.1  
063 A000000 0  
063 B000000 20.9  
064 A000000 N

PAGE 5

064 B000000 Y  
065 000000 N  
066 A000000 N  
067 000000 N  
068 A000000 N  
068 B000000 N  
069 000000 N  
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  
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

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

070	O020000	N	
070	P010000	Y	
070	P020000	N	
070	Q010000	Y	
070	Q020000	N	
070	R010000	N	
070	R020000	N	
071	A000000		0
071	B000000		2450
071	C000000		40448
071	D000000		0
072	A000000	6	
072	B000000		6889
072	C000000		0
072	D000000		0
	PAGE	6	
072	E000000		0
072	F000000		185
072	G000000		50
072	H000000		0
072	I000000		15
072	J000000		5
072	K000000		0
072	L000000		34
072	M000000		20
072	N000000		0
072	O000000		-176
072	P000000		20
072	Q000000		0
072	R000000		20
072	S000000		24
072	T000000		0
072	U000000		0
072	V000000		0
072	W000000		44
072	X000000		241
072	Y000000		0
072	Z000000		6648
072AA	000000		0
072BB	000000		19510
072CC	010000		0
072CC	020000		6277
072DD	010000		6878
072DD	020000		0
072EE	000000		0
073	A010000		0.7600
073	A020000		0.0000
073	B000000		0.0000
073	C000000		0.0000
074	A000000		1331
074	B000000		0
074	C000000		0
074	D000000		31317
074	E000000		376
074	F000000		0
074	G000000		0
074	H000000		0
074	I000000		0
074	J000000		0
074	K000000		714
074	L000000		0
074	M000000		20

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

074 N000000 33758  
 074 O000000 0  
 074 P000000 28  
 074 Q000000 0  
 074 R010000 0

PAGE 7

074 R020000 0  
 074 R030000 0  
 074 R040000 80  
 074 S000000 0  
 074 T000000 33650  
 074 U010000 9098  
 074 U020000 0  
 074 V010000 3.70  
 074 V020000 0.00  
 074 W000000 0.0000  
 074 X000000 13  
 074 Y000000 0  
 075 A000000 0  
 075 B000000 40954  
 076 000000 4.66

077 A000000 Y  
 077 B000000 N  
 077 C000000 Y  
 077 D000000 N  
 077 E000000 Y  
 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 C000000 0  
 081 B000000 0  
 082 B000000 0  
 083 B000000 0  
 084 B000000 0  
 086 A010000 63  
 086 A020000 286  
 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

PAGE 8

086 F020000 0  
 087 A010000 COMMON STOCK  
 087 A020000 337347108  
 087 A030000 FHI

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

088 A000000 N

088 B000000 N

088 C000000 N

088 D000000 N

SIGNATURE JAMES M. DYKAS

TITLE ASSISTANT TREASURER