

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

FIRST TRUST STRATEGIC HIGH INCOME FUND

Form NSAR-A

June 27, 2008

PAGE 1
000 A000000 04/30/2008
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 6302414141
002 A000000 1001 WARRENVILLE ROAD SUITE 300
002 B000000 LISLE
002 C000000 IL
002 D010000 60532
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 LISLE
008 D020001 IL
008 D030001 60532
008 A000002 VALHALLA CAPITAL PARTNERS, LLC
008 B000002 S
008 C000002 801-64440
008 D010002 LOUISVILLE
008 D020002 KY
008 D030002 40223
010 A000001 PFPC INC
010 B000001 84-1761
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 PFPC, 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-A

015	C010001	PHILADELPHIA	
015	C020001	PA	
015	C030001	19153	
015	E010001	X	
018	000000	Y	
019	A000000	Y	
019	B000000	59	
019	C000000	FIRSTDEFIN	
021	000000	0	
022	A000001	JEFFRIES & CO	
022	B000001	95-2622900	
022	C000001	0	
022	D000001	9190	
022	A000002	UCM, INC.	
022	B000002	54-1779870	
022	C000002	3571	
022	D000002	0	
022	A000003	STIFEL NICOLAUS & CO. INC.	
022	B000003	43-0538770	
022	C000003	1303	
022	D000003	0	
022	A000004	LEHMAN BROTHERS HOLDINGS	
022	B000004	13-3216325	
022	C000004	787	
022	D000004	0	
023	C000000	5661	
023	D000000	9190	
024	000000	N	
025	D000001	0	
025	D000002	0	
025	D000003	0	
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	
	PAGE	3	
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	

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

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
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
	PAGE	4
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
054	A000000	Y

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

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 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
 PAGE 5
 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 9.0
 062 Q000000 123.2
 062 R000000 6.2
 063 A000000 0
 063 B000000 21.2
 064 A000000 N
 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

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

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	
	PAGE	6	
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		8631
071	B000000		11413
071	C000000		156440
071	D000000		6
072	A000000	6	
072	B000000		11192
072	C000000		1317
072	D000000		0
072	E000000		0
072	F000000		732
072	G000000		81
072	H000000		0
072	I000000		19
072	J000000		17
072	K000000		0
072	L000000		33
072	M000000		15
072	N000000		0
072	O000000		284
072	P000000		1425
072	Q000000		0
072	R000000		49
072	S000000		35
072	T000000		0
072	U000000		0
072	V000000		0
072	W000000		158
072	X000000		2848
072	Y000000		0
072	Z000000		9661
072AA	000000		0
072BB	000000		18801
072CC	010000		0
072CC	020000		22185
072DD	010000		8624

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

072DD020000	0
072EE000000	0
073 A010000	0.9600
073 A020000	0.0000
073 B000000	0.0000
PAGE 7	
073 C000000	0.0000
074 A000000	5819
074 B000000	0
074 C000000	0
074 D000000	127368
074 E000000	5946
074 F000000	0
074 G000000	0
074 H000000	0
074 I000000	0
074 J000000	0
074 K000000	0
074 L000000	1724
074 M000000	0
074 N000000	140857
074 O000000	0
074 P000000	107
074 Q000000	44000
074 R010000	0
074 R020000	0
074 R030000	0
074 R040000	417
074 S000000	0
074 T000000	96333
074 U010000	8996
074 U020000	0
074 V010000	10.71
074 V020000	0.00
074 W000000	0.0000
074 X000000	14
074 Y000000	0
075 A000000	0
075 B000000	112081
076 000000	12.73
077 A000000	Y
077 B000000	N
077 C000000	Y
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	Y
PAGE 8	
077 Q020000	N
077 Q030000	N
078 000000	N
080 C000000	0

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

081	B000000	0
082	B000000	0
083	B000000	0
084	B000000	0
086	A010000	13
086	A020000	138
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	