

BANCO DAYCOVAL S.A.

Companhia Aberta

CNPJ/MF nº 62.232.889/0001-90 - CVM nº 20796

NIRE 35300524110

FATO RELEVANTE

BANCO DAYCOVAL S.A. (BM&FBovespa: DAYC4), instituição financeira com sede na capital do Estado de São Paulo, na Avenida Paulista, nº 1.793, inscrita no CNPJ/MF sob nº 62.232.889/0001-90 (“Companhia” ou “Banco Daycoval”), nos termos da Instrução CVM nº 358/02, vem informar aos seus acionistas e ao mercado em geral que os bônus de subscrição de ações preferenciais da Companhia (“Bônus PN”), objeto de Comunicados ao Mercado anteriores datado de 19 de abril e 16 de junho de 2010, passarão a ser admitidos à negociação no pregão da BM&FBOVESPA S.A. - Bolsa de Valores, Mercadorias e Futuros (“BM&FBOVESPA”) a partir de 4 de abril de 2011 sob o ticker “DAYC11”.

As principais características dos Bônus PN estão descritas no Aviso aos Acionistas datado de 19 de fevereiro de 2009, sendo importante destacar que:

- (i) somente os Bônus PN passam a ser admitidos à negociação no pregão da BM&FBOVESPA;
- (ii) a partir de 31 de março de 2011, os detentores de Bônus PN (ou bônus de subscrição de ações ordinárias - “Bônus ON”) podem subscrever ações preferenciais (ou ações ordinárias) trimestralmente, até 31 de março de 2014;
- (iii) cada Bônus PN conferirá ao seu titular o direito de subscrever 1 (uma) ação preferencial (e cada Bônus ON conferirá ao seu titular o direito de subscrever 1 (uma) ação ordinária);
- (iv) o preço de exercício dos Bônus PN e dos Bônus ON para subscrição de ações ordinárias ou preferenciais é de R\$ 7,75 por ação;
- (v) após o exercício dos Bônus PN (ou Bônus ON) seu titular receberá recibos de subscrição de suas respectivas ações, os quais serão negociáveis na BM&FBOVESPA e substituídos por ações após a homologação, pelo Banco Central do Brasil, da ata da Reunião do Conselho de Administração da Companhia que deliberar sobre o aumento de

capital decorrente do exercício dos Bônus PN (ou Bônus ON), o que será divulgado pela Companhia por meio de Comunicado ao Mercado;

(vi) as ações emitidas em decorrência do exercício dos Bônus ON ou dos Bônus PN conferirão aos seus titulares os mesmos direitos e vantagens atribuídos às ações ordinárias e ações preferenciais de emissão da Companhia, participando de forma integral nos dividendos, juros sobre capital próprio e quaisquer outros valores que vierem a ser declarados pela Companhia a partir da data de homologação da ata de Reunião do Conselho de Administração, pelo Banco Central do Brasil, que deliberar sobre o aumento de capital social decorrente do exercício dos Bônus ON ou dos Bônus PN.

São Paulo, 01 de abril de 2011.

Morris Dayan

Diretor de Relações com os Investidores