Junto às muralhas de Aveiro vivia Afonso Domingues, um humilde lavrador, muito religioso que trabalhava de sol a sol, não sendo poupado pelo frio, pelo sol e pela chuva. Sujeito a estas intempéries a sua saúde degradou-se com o tempo, chegando mesmo a perder a força nas pernas, deixando de as mexer. Apesar de muito doente e sem poder trabalhar, mendigando pela pelas ruas da vila, nunca perdeu a fé e sempre pediu ajuda;

Uma noite, enquanto dormia, a porta da casa abriu-se e uma luz muito forte inundou toda a casa. À entrada da porta apareceu uma senhora branca como a neve, mais brilhante que os raios solares, envergando um manto azul da cor do céu. A Senhora, baixou-se segurou-lhe na mão e disse-lhe: “Anda comigo lá fora”;

O pobre homem, ainda assombrado, levantou-se e veio para a rua. Foi então que viu a Senhora com o Menino Jesus ao colo, sentada na escada que dava acesso à muralha e que lhe disse:
“Afonso as tuas preces foram ouvidas, agora vai ter com o Infante D. Pedro e conta-lhe o que viste e ouviste e diz-lhe que está na hora dele cumprir o voto que me fez de construir um convento e que deve ser neste sítio”;

Afonso Domingues, sem hesitação, caminhou até ao palácio do Infante e contou-lhe o sucedido. O Infante perante tal milagre e a manifestação da Virgem Maria, logo deu instruções para a construção do convento e em memória do milagre realizado colocou-o sob a invocação de Nossa Senhora da Misericórdia, entregando o convento à Ordem de S. Domingos;

Posteriormente foi colocada uma imagem de Nossa Senhora com o Menino ao colo em um nicho na muralha ao cimo das escadas, em memória de uma grande devoção a esta Nossa Senhora da Escadinha. Mais tarde, a imagem foi mudada para um nicho no exterior da igreja e em 1976, aquando das grandes obras, foi colocada no seu interior;

Do convento da Nossa Senhora da Misericórdia, apenas resta a Igreja e muito modificada, que é a Igreja de Nossa Senhora da Glória – Sé da Diocese de Aveiro.